



每日国内期货收盘数据和点评

制作日期：2024年10月21日

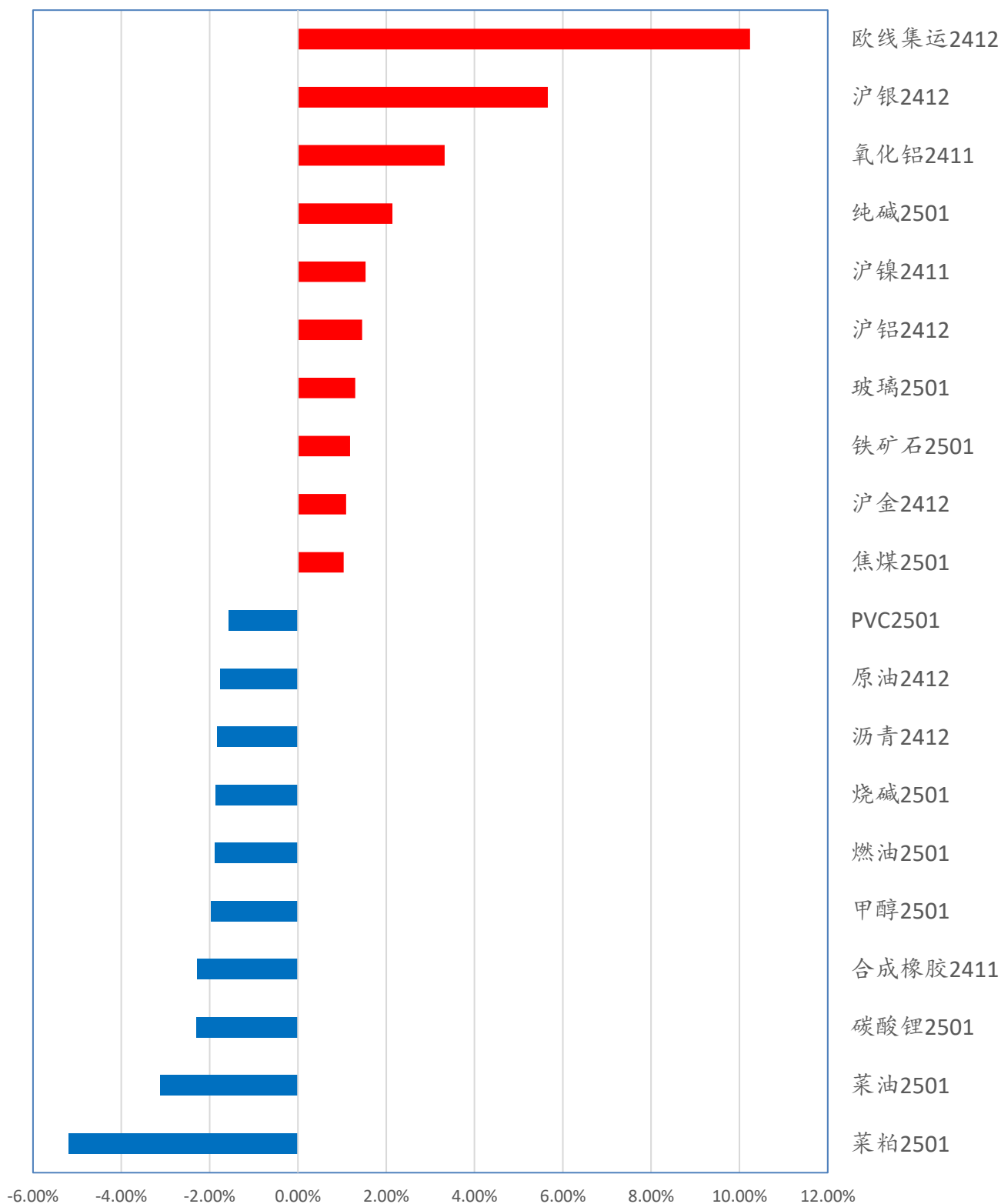
内容摘要：

- 每日商品期货涨跌幅排名
- 每日商品期货成交金额排名
- 每日商品期货资金沉淀排名
- 每日期货主要合约基差变化
- 每日主力合约期货价格历史百分位比较
- 每日热点评论



■ 每日商品期货涨跌幅排名

商品期货涨跌幅 (%)

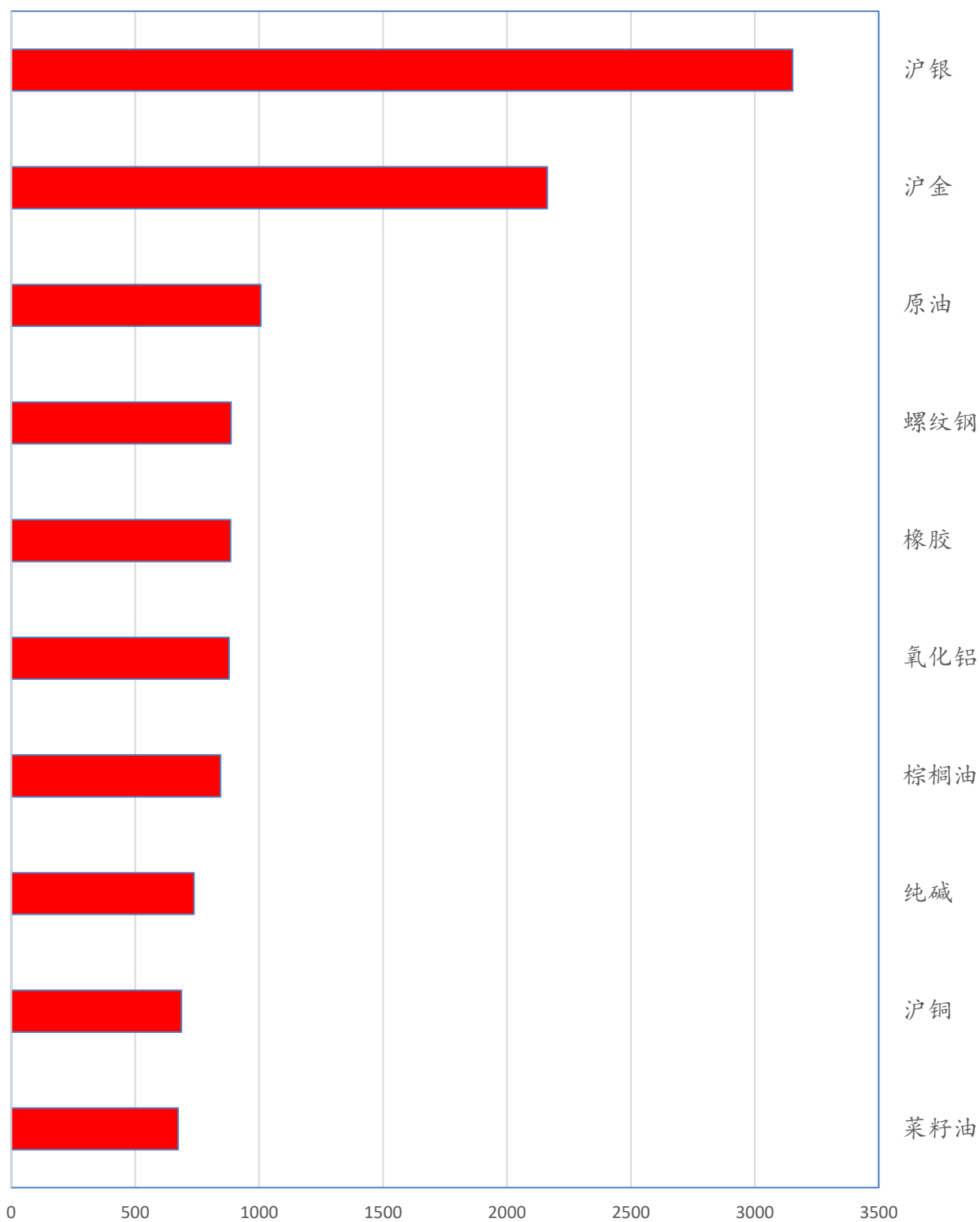


数据来源：文华财经



■ 每日商品期货成交金额排名

商品期货成交金额（亿元）

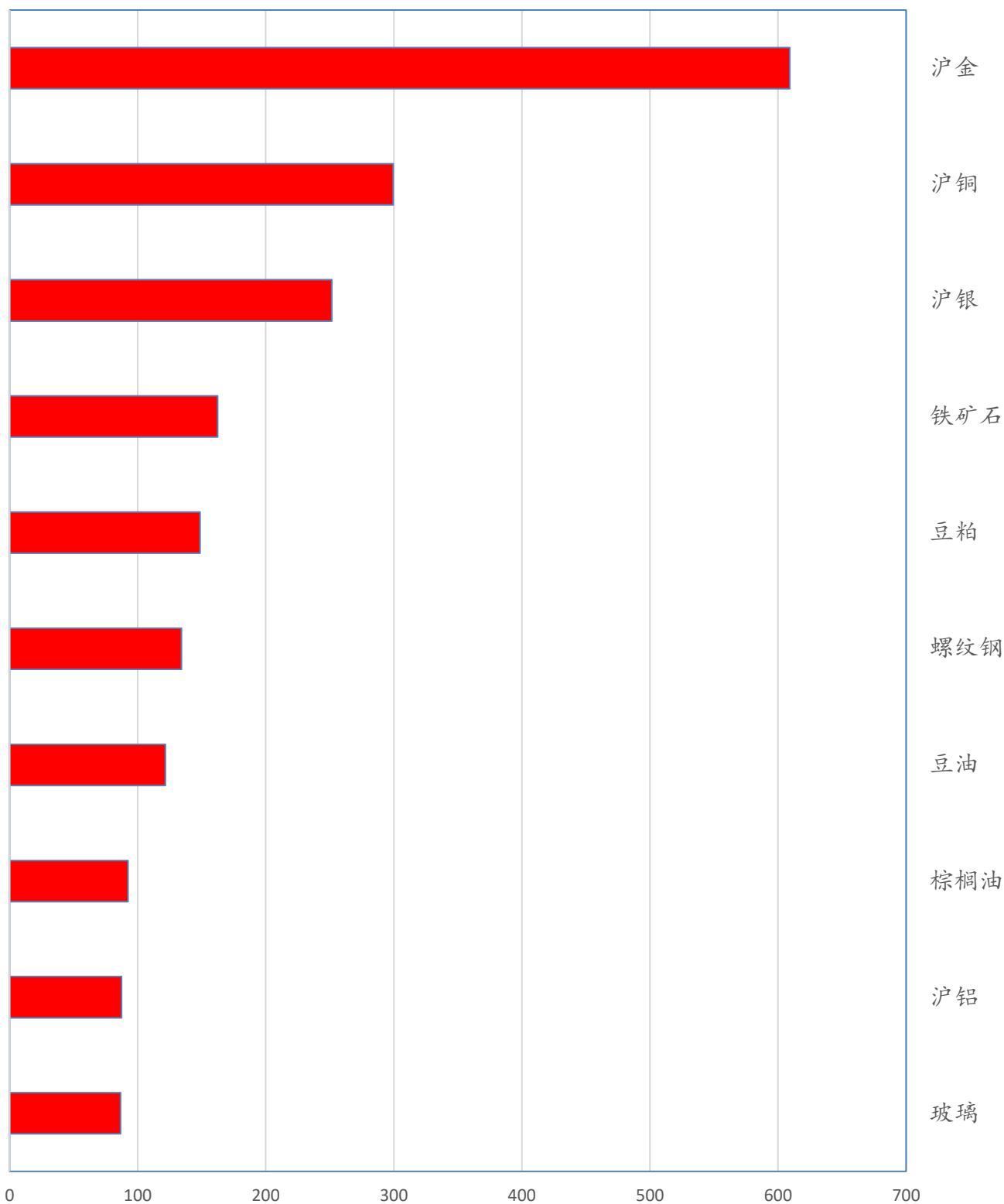


数据来源：文华财经



■ 每日商品期货资金沉淀排名

商品期货沉淀资金（亿元）



数据来源：文华财经



每日期货主要合约基差变化

期货主要品种基差

制表：华鑫期货研究所					(收盘价计算)		2024/10/21	
板块	代码	品种	基差	基差变动	基差率	期货收	现货价	备注
		(主力连续)	(现货-期货)	(日环比)	(基差/现货)	盘价	(折合盘面价)	
金融	IF	沪深300	-7.2	1.96	-0.18%	3942.4	3935.2	
	IH	上证50	-9.7	4.55	-0.36%	2690.8	2681.1	
	IM	中证1000	38.0	16.54	0.65%	5822.6	5860.6	
	IC	中证500	21.8	-11.99	0.38%	5682.4	5704.2	
金属	CU	铜	40.0	630.00	0.05%	77620	77660	上海物贸
	AL	铝	-160.0	-10.00	-0.77%	20940	20780	上海物贸
	ZN	锌	185.0	285.00	0.73%	25230	25415	上海物贸
	NI	镍	-790.0	-1310.00	-0.61%	130720	129930	上海金属网
	AO	氧化铝	-306.0	-110.00	-6.56%	4971	4665	山东地区氧化铝中间价
	SS	不锈钢	535.0	-90.00	3.72%	13865	14400	304/2B冷轧不锈钢卷太钢无锡
黑色	RB	螺纹钢	152.0	-52.00	4.33%	3358	3510.0	上海HRB400E 20mm
	HC	热卷	-38.0	-7.00	-1.09%	3518	3480	上海Q235B 4.75mm
	J	焦炭	-29.5	-19.50	-1.50%	1997.5	1968	天津港准一级冶金焦
	JM	焦煤	275.0	-14.00	16.77%	1365	1640	山西晋中中硫主焦煤 (\$1.3)
	I	铁矿石	29.8	2.90	3.73%	769.5	799.3	青岛港金布巴粉
	SM	锰硅	222.0	38.00	3.50%	6128	6350.0	内蒙FeMn65Si17+地区贴水400
	FG	玻璃	-66.0	-26.00	-5.59%	1246	1180.0	华北地区5mm浮法玻璃含税价
能化	SC	原油	-0.4	7.73	-0.08%	527.9	527.5	原油(阿曼)
	PG	液化石油气	438.0	44.00	8.59%	4662	5100.0	广州码头液化气(国产气)
	BU	沥青	507.0	60.00	13.63%	3213	3720	华东主流市场价
	RU	天胶	-1070.0	25.00	-6.26%	18170	17100	上海云南国营全乳胶(SCRWF)
	NR	20号标胶	536.2	128.68	3.60%	14370	14906	泰国STR20青岛保税区库提价
	MA	甲醇	-1.0	3.00	-0.04%	2386	2385	华东市场低端价
	L	塑料	321.0	63.00	3.82%	8079	8400	齐鲁石化7042出厂价
	PP	聚丙烯	-41.0	74.00	-0.55%	7441	7400	绍兴三圆T30S出厂价
	EB	苯乙烯	192.0	-15.00	2.21%	8498	8690	华东市场低端价
	V	PVC	-6.0	85.00	-0.11%	5367	5361	电石法全国均价
	PF	短纤	250.0	44.00	3.53%	6830	7080	华东市场涤纶短纤1.4D主流价
	EG	乙二醇	109.0	68.00	2.32%	4581	4690	华东市场低端价
	TA	PTA	-92.0	-20.00	-1.89%	4962	4870	华东地区高端价
	LC	碳酸锂	1550.0	-1800.00	2.09%	72450	74000	电池级碳酸锂市场价
	SA	纯碱	69.0	-31.00	4.45%	1481	1550	华北地区沙河市场重质纯碱主流价
	UR	尿素	-29.0	6.00	-1.61%	1829	1800	河南地区小颗粒主流价
农产品	A	豆一	-102.0	13.00	-2.64%	3962	3860	哈尔滨巴彦国一等大豆
	Y	豆油	114.0	-112.00	1.37%	8206	8320	张家港四级豆油
	P	棕榈油	200.0	-44.00	2.21%	8860	9060	黄埔港
	OI	菜油	47.0	28.00	0.50%	9273	9320	江苏南通四级菜油
	M	豆粕	65.0	10.00	2.13%	2985	3050	张家港
	RM	菜粕	-112.0	57.00	-5.07%	2322	2210	黄埔(加籽粕)
	SR	白糖	581.0	26.00	9.05%	5840	6421	广西一级糖报价
	CF	棉花	1401.0	41.00	9.09%	14020	15421	中国棉花价格指数328
	C	玉米	644.5	28.00	22.90%	2170	2815	收购价平均价
	CS	玉米淀粉	140.0	26.00	5.17%	2570	2710	长春出厂报价
	LH	生猪	1970.0	-275.00	11.45%	15230	17200	河南出厂价
	JD	鸡蛋	1008.0	58.00	22.01%	3572	4580	湖北孝感平均价
备注：数据均来源于wind，现货价格仅代表部分可交割参考价格，未含交割成本。基差及其变动仅供参考。								



每日主力合约期货价格历史百分位比较

华鑫期货 CHINA FORTUNE FUTURES		主力合约期货价格历史百分位比较		2024/10/21	
碳酸锂	1.28%	豆油	33.50%	原油	52.19%
花生	8.02%	聚丙烯	33.71%	1000股指	52.94%
纯碱	8.18%	鸡蛋	34.40%	玉米	54.61%
对二甲苯	8.40%	焦炭	35.38%	棕榈油	55.33%
PVC	10.72%	乙二醇	35.67%	沪锡	56.12%
生猪	15.67%	菜籽油	36.36%	苯乙烯	57.96%
棉花	16.53%	热卷	36.48%	工业硅	61.11%
不锈钢	16.67%	螺纹钢	37.91%	沪锌	61.93%
尿素	18.07%	50股指	38.98%	白糖	63.36%
红枣	18.24%	LU燃油	42.23%	国际铜	68.80%
玻璃	18.77%	豆一	42.23%	沪铝	74.42%
PTA	19.87%	沪铅	44.49%	BR橡胶	77.16%
硅铁	20.57%	铁矿石	45.28%	三十年债	83.90%
500股指	22.81%	豆二	47.29%	沪铜	84.96%
菜籽粕	23.38%	纸浆	48.18%	二年债	87.79%
塑料	23.88%	沥青	48.39%	20号胶	91.17%
苹果	23.99%	集运欧线	48.98%	沪银	93.36%
焦煤	25.94%	豆粕	49.08%	十年债	95.03%
锰硅	26.90%	300股指	49.49%	五年债	96.40%
沪镍	30.93%	液化气	49.88%	氧化铝	99.91%
短纤	31.60%	淀粉	49.92%	沪金	99.95%
甲醇	31.62%	燃料油	50.89%		
橡胶	31.87%	烧碱	51.61%		

注：底色标蓝的品种表示上市时间不超过3年该值的参考价值需要打折
制表：华鑫期货研究所

■ 每日热点评论

1、股指

【盘面】A股主要指数收涨，但均脱离当日高点，上证上涨0.2%，深成指上涨1.09%，创业板上涨0.69%，科创50指数上涨2.22%，北证50指数上涨超16%，创历史新高。全市场成交22289亿元，放量983亿元，全市场超3700只个股上涨。期指冲高回落，今日港股表现欠佳，对A股影响消极，恒生指数跌1.57%，恒生科技股跌2.37%。期指继续分化，IF和IH较周五收盘价变化不大，IC和IM较上周五收盘超1%，

【分析】继续维持做多策略，但近期波动较大，需重视持仓管理。

【估值】中性偏低

【风险】外围

2、铜铝CU&AL

【盘面】周五夜盘沪铜小幅高开后震荡，周一白天盘继续回升，并强势收盘，主力12月收盘于77730，涨1.44%，成交小幅放量，总持仓增加超过6千手。氧化铝午后强势拉涨，再创历史新高，带动了沪铝回升，主力12月收20940，涨1.65%，成交放量，总仓增加超过2万手。

【分析】今早央行下调1年期和5年期LPR均25个基点，略超市场预期，市场的宏观情绪回升带动有色整体出现反弹。近期LME铜库存持续下降，本周末国内铜社会库存也首次在节后出现了停止增长。关注消费旺季阶段，铜需求的进一步改善情况。而铝面临产能和产能利用率天花板，同时需求端也表现较强，近期氧化铝持续新高，也提振铝上行。维持铜看多策略，技术上沪铜在75000-76000即今年8月底的高点支撑较强，操作上可依托此区域，寻机逢低吸纳，而铝已强势回归，维持中期看涨策略，短期关注前高阻力。

【估值】中性

【风险】宏观和产业

3、黄金白银AU&AG

【盘面】沪金主力12月震荡上升，主力收于625.82，涨幅为1.22%，成交量减少，持仓量增加8000余手。沪银弹性更大，沪银主力收于8343，涨幅为5.86%，成交量放大，持仓量增加近8万手。

【分析】今日黄金继续创历史新高，已连续8个交易日上升。央行下调LPR基点略超出市场预期，使得贵金属开盘拉高。十一月美国大选临近，俄乌冲突与朝鲜半岛冲突不确定因素存在，黄金作为避险资产受到青睐，白银受到影响共振上升，涨幅为近今日商品之冠。维持贵金属多配策略，但需重视持仓管理。短期跟踪股市后续的变化以及宏观情绪的变化，避免宏观情绪造成的干扰。

【估值】偏高

【风险】宏观

4、碳酸锂LC

【盘面】碳酸锂主力合约换月LC2501合约，收跌1.76%，收于72450。成交量减少，持仓量增加9000余手。

【分析】碳酸锂持续震荡摩底，基本面疲软，市场需求不佳，价格内卷仍较激烈，库存压力仍然较大，厂商套期保值压力在价格上方施压。将维持震荡摩擦底部，维持震荡偏空思路。

【估值】偏低

【风险】产业

5、螺纹热卷RB&HC

【盘面】RB2501收于3358，涨0.66%，HC2501收于3518，涨0.2%。

【分析】今日央行1年期与5年期LPR均下调25个基点。宽松的货币政策利多钢材价格。产业方面，螺纹热卷库存持续下降，钢厂复产增产，日均铁水超234万吨，钢材供应增加，同时贸易商开始冬储，对钢材价格形成支撑。预计钢材价格震荡偏强。

【估值】中等

【风险】宏观与政策

6、纸浆SP

【盘面】SP2501收于5890元/吨，涨0.55%。

【分析】宏观方面，今日央行1年期与5年期LPR均下调25个基点。宽松的货币政策利多纸浆。产业方面，全球漂针浆几乎无新增产能，阔叶浆新增产能较多，巴西Suzano新增255万吨阔叶浆已投产，今年国内还有200多万吨产能待投产。上期所仓单39.06万吨，山东俄针现货价格5800元/吨。在国内宽松的货币政策背景下，预计纸浆在5600-6100区间震荡。

【估值】中等

【风险】供应扰动

7、油脂油料

【盘面】菜系快速下挫，豆粕独自飘红。豆油主力01月收8206，跌0.92%；菜油主力01月收9273，跌3.23%；棕榈油主力01月收8860，跌0.89%；豆粕主力01月收2985，涨0.51%，菜粕主力01月收2322，跌4.05%。

【分析】加拿大财政部宣布允许加拿大企业申请减免从中国进口的电动汽车、钢铝制品等加征的关税，此消息缓和了市场对中加贸易关系的担忧，菜系受此影响集体大幅下挫，豆粕菜粕价差也从前一个交易日的546元/吨扩大至今日的663元/吨。菜油的大幅下跌也使得带动棕榈油、豆油回落。棕榈油内外盘走势分化，马来西亚棕榈油10月1-20日产量环比下滑，而出口环比增加，提振马棕油震荡走强，受马棕油走强的影响国内棕榈油跌幅收窄。预计后市菜粕或维持弱势，不过菜油受近期油脂强势的影响，其支撑或强于菜粕。

【估值】中性

【风险】产区天气 宏观

8、棉花CF

【盘面】棉花震荡收跌，主力01月收14020，跌0.21%。

【分析】棉花内外盘走势分化，美棉小幅走高而郑棉小幅收跌。CFTC持仓报告数据显示，截至10月15日当周，ICE美棉花基金净空持仓量为10642手，较上周减少999手，净空持仓小幅减少。新疆棉花主产区进入采收高峰期，棉籽收购和加工快于去年，新棉大量上市，轧花厂利润不佳。在供应压力下，预计棉花上方空间有限，关注宏观情绪变化以及棉花下游需求情况。

【估值】中性

【风险】产区天气 宏观

9、三大胶RU&NR&BR

【盘面】周五夜盘三大胶高位回落，日盘回调整理。沪胶主力 2501 收 18170，涨幅为 0.06%；BR 橡胶主力 2411 收 15205，跌幅为 2.03%；20 号胶主力 2412 收 14370，跌幅为 0.69%。

【分析】近期橡胶基本面没有显著变化，胶价进入震荡整理阶段。随着天气有所改善，市场更加关注新胶上量情况。上周青岛库存止跌小幅回升，本周还需关注青岛库存变动，预计短期仍维持震荡偏弱。顺丁橡胶现货市场均价为 16050 元/吨，较前一交易日下调 230 元/吨。原油价格延续跌势，影响原料丁二烯走弱，市场看空情绪升温，需求端入淡季，合成胶焦点在丁二烯及天然橡胶走势。

【估值】中性

【风险】宏观 产区天气

注意事项

本文中的信息均来源于公开资料，华鑫期货研究所及相关研究人员力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。我们已力求文章内容客观、公正，但文章中的信息与所表达的观点不构成所述期货买卖的出价或询价的依据，该等信息、意见并未考虑到获取本文人员的具体投资目的、财务状况以及特定需求，在任何时候均不构成对任何人的个人推荐。对依据或者使用本文所造成的一切后果，华鑫期货及其关联人员均不承担任何法律责任。

本文中的资料、意见、预测均只反映文章初次发布时的判断，可能会随时调整。该等意见、评估及预测无需通知即可随时更改。华鑫期货没有将此意见及建议向文章所有接收者进行更新的义务。本文仅供内部参考交流使用，不构成投资建议。如未经授权，私自转载或者转发本文，所引起的一切后果及法律责任由私自转载或转发者承担。华鑫期货将保留随时追究其法律责任的权利。

华鑫期货研究所立足诚信和专业，秉承“高效研究 创造价值”的理念，深谙“知微见著，臻于至善”的投研内核，并基于宏观、产业、市场风偏和估值构建“四维一体”决策模型，助力各类客户包括产业型客户和交易型客户的成长。

侯梦倩

期货从业资格：F3070960

投资咨询资格：Z0017338

邮箱：houmq@shhxqh.com

华鑫期货有限公司

地址：上海市黄浦区福州路666号21、22楼

邮编：200001

电话：400-186-8822

华鑫期货

华鑫期评

