



## 每日国内期货收盘数据和点评

制作日期：2024年1月18日

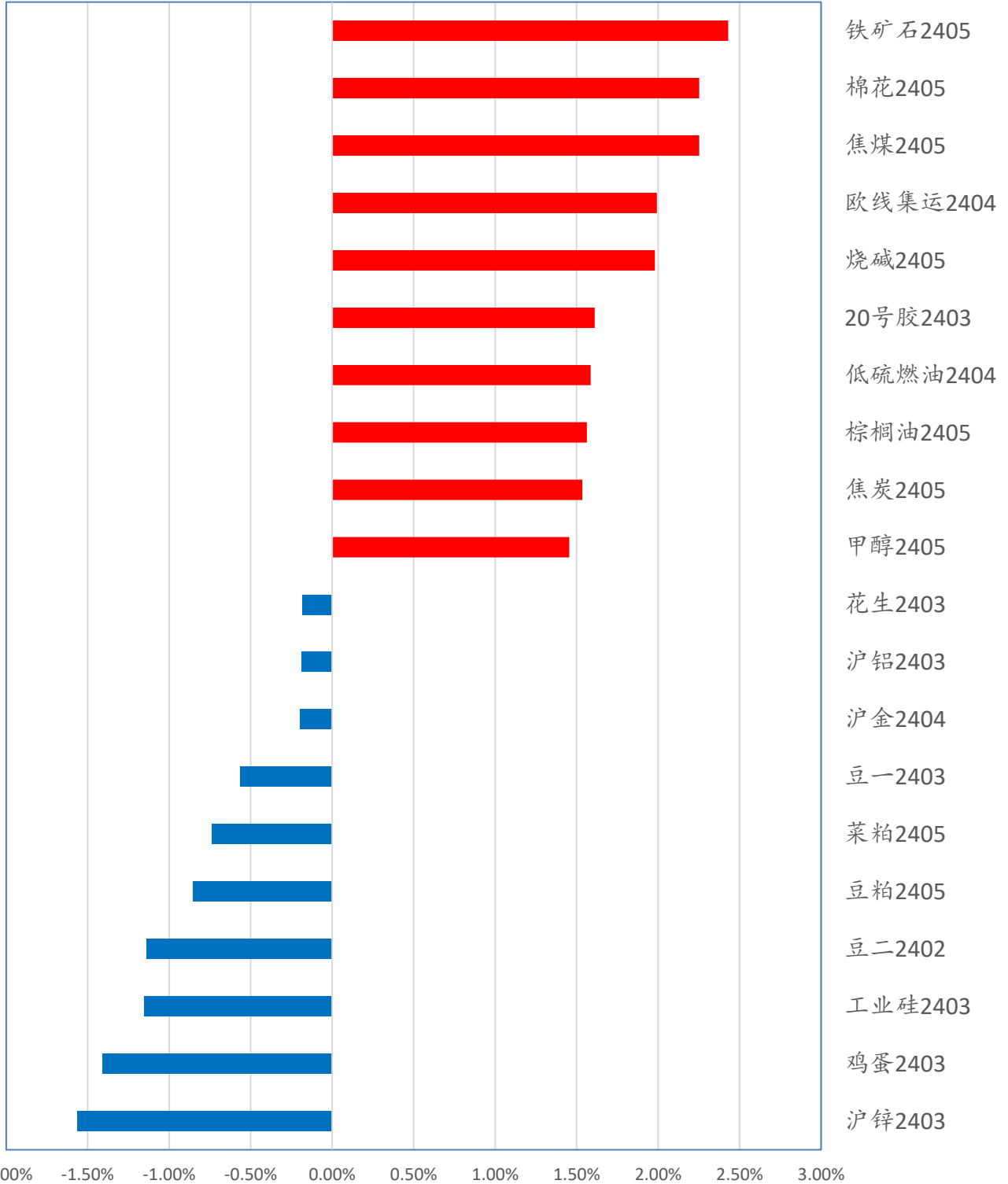
内容摘要：

- 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
- 主要外资背景的期货公司净持仓情况
- 每日热点评论



每日商品期货涨跌幅排名

商品期货涨跌幅 (%)

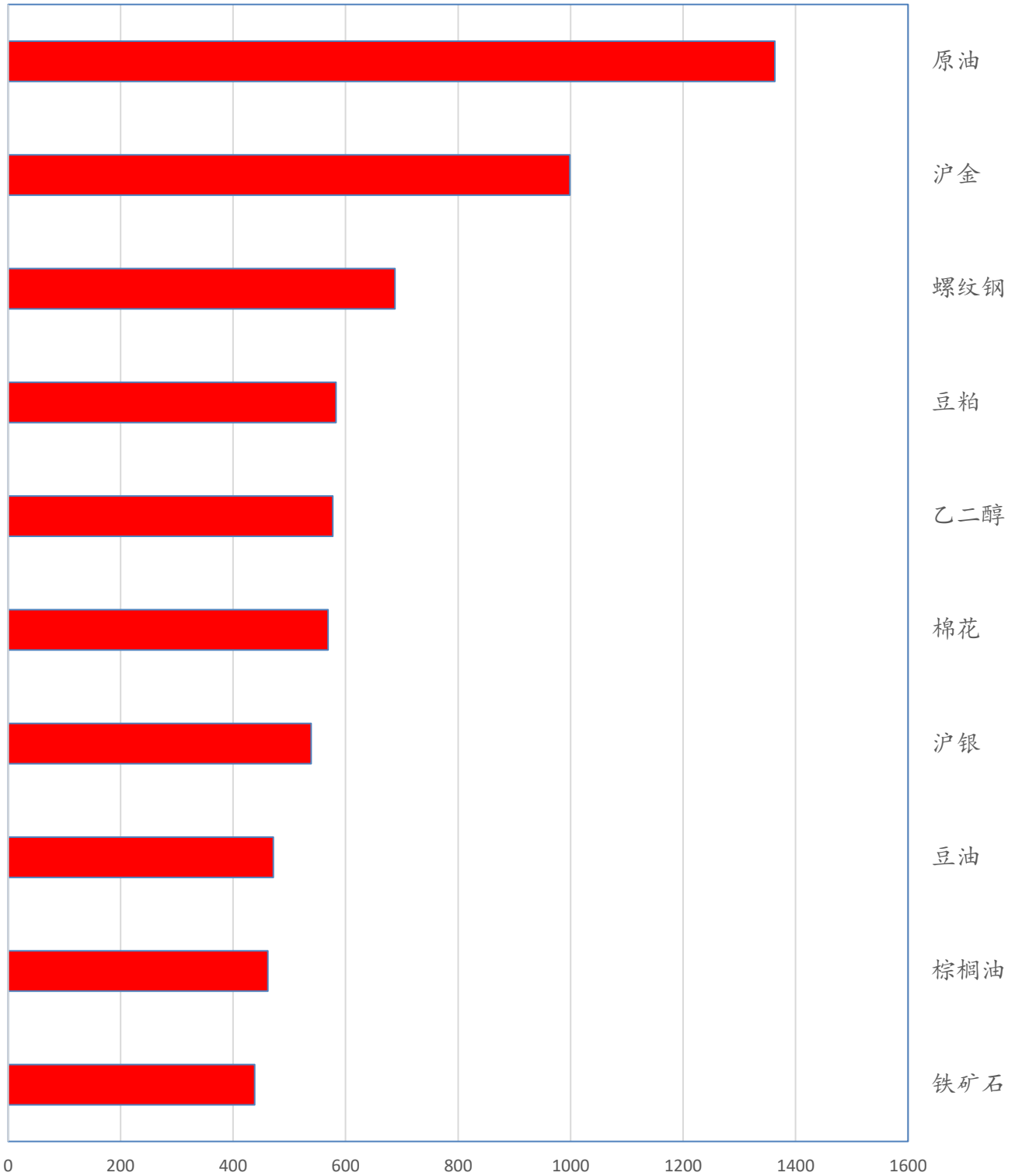


数据来源：文华财经



每日商品期货成交金额排名

商品期货成交金额（亿元）

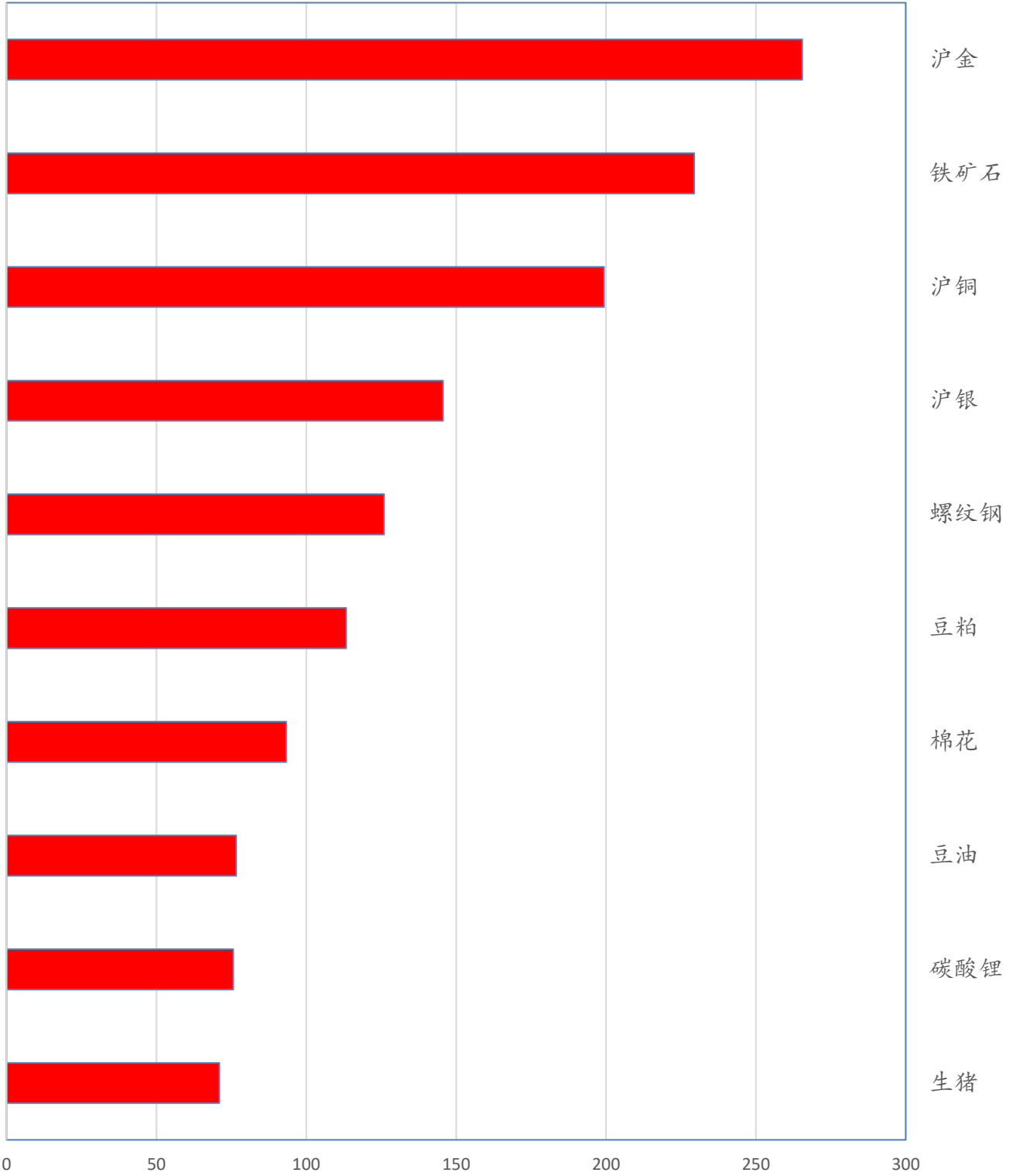


数据来源：文华财经



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)

2024/1/18

日期	代码	品种	基差	基差变动	基差率	期货收	现货价	备注
Date		(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	25.5	97.85	0.78%	3249.2	3274.7	
	IH	上证50	12.5	64.60	0.56%	2226	2238.5	
	IM	中证1000	28.8	152.70	0.54%	5344.6	5373.4	
	IC	中证500	22.0	133.82	0.43%	5045	5067.0	
金属	CU	铜	-195.0	-360.00	-0.29%	67870	67675	上海物贸
	AL	铝	85.0	-110.00	0.45%	18795	18880	上海物贸
	ZN	锌	125.0	40.00	0.60%	20770	20895	上海物贸
	NI	镍	1180.0	-1860.00	0.91%	128260	129440	上海金属网
	AO	氧化铝	-30.0	-11.00	-0.93%	3245	3215	山东地区氧化铝中间价
	SS	不锈钢	270.0	-285.00	1.88%	14130	14400	304/2B冷轧不锈钢卷太钢无锡
黑色	RB	螺纹钢	-13.0	-134.90	-0.33%	3913	3900.0	上海HRB400 20mm
	HC	热卷	-30.0	-1.00	-0.75%	4030	4000	上海Q235B 4.75mm
	J	焦炭	5.5	-21.00	0.22%	2446.5	2452	天津港准一级冶金焦
	JM	焦煤	283.5	-18.00	13.50%	1816.5	2100	山西晋中中硫主焦煤(S1.3)
	I	铁矿石	105.7	-24.20	10.03%	948.5	1054.2	青岛港金布巴粉
	SM	锰硅	-266.0	-50.00	-4.34%	6396	6130.0	内蒙FeMn65Si17
	FG	玻璃	65.0	-5.00	3.57%	1755	1820.0	华北地区5mm浮法玻璃含税价
能化	SC	原油	-7.5	-5.37	-1.38%	555.8	548.3	原油(阿曼)
	PG	液化石油气	820.0	15.00	15.83%	4360	5180.0	广州码头液化气(国产气)
	BU	沥青	89.0	-27.00	2.33%	3731	3820	华东主流市场价
	RU	天胶	-1010.0	-85.00	-7.86%	13860	12850	上海云南国营全乳胶(SCRWF)
	NR	20号标胶	-323.0	-114.07	-2.93%	11355	11032	泰国STR20青岛保税区库提价
	MA	甲醇	74.0	8.00	3.03%	2371	2445	华东市场低端价
	L	塑料	121.0	-7.00	1.46%	8179	8300	齐鲁石化7042出厂价
	PP	聚丙烯	-78.0	-3.00	-1.07%	7348	7270	延安炼化t30s出厂价
	EB	苯乙烯	7.0	143.00	0.08%	8673	8680	华东市场低端价
	V	PVC	-315.0	-49.00	-5.68%	5864	5549	电石法全国均价
	PF	短纤	-230.0	-58.00	-3.17%	7480	7250	华东市场涤纶短纤1.4D主流价
	EG	乙二醇	1.0	26.00	0.02%	4679	4680	华东市场低端价
	TA	PTA	-59.0	-16.00	-1.02%	5844	5785	CCFEI价格指数(内盘)
	LC	碳酸锂	-6400.0	1750.00	-6.67%	102400	96000	电池级碳酸锂市场价
SA	纯碱	395.0	7.00	17.17%	1905	2300	华北地区沙河市场重质纯碱主流价	
UR	尿素	188.0	13.00	8.36%	2062	2250	河南地区小颗粒主流价	
农产品	A	豆一	66.0	23.00	1.36%	4774	4840	哈尔滨巴彦国一等大豆
	Y	豆油	716.0	32.00	8.73%	7484	8200	张家港四级豆油
	P	棕榈油	48.0	62.00	0.64%	7412	7460	黄埔港
	OI	菜油	-37.0	-73.00	-0.46%	8017	7980	江苏南通四级菜油
	M	豆粕	412.0	-25.00	11.98%	3028	3440	张家港
	RM	菜粕	76.0	18.00	2.88%	2564	2640	黄埔(加籽粕)
	SR	白糖	101.0	-58.00	1.57%	6340	6441	广西一级糖报价
	CF	棉花	686.0	-293.00	4.14%	15890	16576	中国棉花价格指数328
	C	玉米	456.5	28.00	16.22%	2358	2815	收购价平均价
	CS	玉米淀粉	165.0	16.00	5.50%	2835	3000	长春出厂报价
	LH	生猪	655.0	60.00	4.58%	13645	14300	河南出厂价
JD	鸡蛋	978.0	85.00	22.90%	3292	4270	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。



主要外资背景的期货公司净持仓情况

1、乾坤期货（2024/1/18）

序号	名称	净持仓				多头持仓			空头持仓		
		净持仓	增减	持仓金额(万元)	持仓额变化(万元)	多单量	增减	持仓金额(万元)	空单量	增减	持仓金额(万元)
1	合计	13421	3044	481,690.8100	-20,379.7100	315777	23590	1,938,340.1900	302356	5094	1,456,649.3900
2	豆一	-37742		-179,764.6900	-1,811.2600	0		0.0000	37742	714	179,764.6900
3	沪铝	5626	-958	52,763.2900	-54,311.1200	9126	42	85,587.9400	3500	1000	32,824.6600
4	沪金	3649		175,006.1800	-3,329.4400	3649	-53	175,006.1800	0		0.0000
5	豆二	-12259	-484	-46,262.0800	-514.7500	4601	-111	17,362.9000	16860	373	63,624.9900
6	国际铜	-226	-398	-6,785.5100	-11,968.8700	993	-473	29,814.2300	1219	-75	36,599.7400
7	沥青	1607		5,979.4900	12.4000	1607	0	5,979.4900	0		0.0000
8	热轧卷板	25849		103,448.6500	-6,398.0100	25849	-1478	103,448.6500	0		0.0000
9	铁矿石	54929	1657	504,800.6800	7,158.6100	56003	1657	514,670.8000	1074	0	9,870.1200
10	中证500期货	-1072		-104,405.4900	-143,476.1300	0		0.0000	1072	0	104,405.4900
11	中证1000期货	-1788		-183,998.0000	4,469.3500	0		0.0000	1788	0	183,998.0000
12	塑料	6278		25,544.7400	25,544.7400	6278	4020	25,544.7400	0		0.0000
13	低硫燃料油	19935		82,060.7500	4,830.5400	19935	1141	82,060.7500	0		0.0000
14	豆粕	-22901	-1058	-69,670.8600	-1,869.3600	46234	103	140,655.9700	69135	1161	210,326.8300
15	甲醇	-33925		-79,608.0100	-3,406.0800	0		0.0000	33925	1380	79,608.0100
16	20号胶	1272	422	14,353.2900	2,454.5600	2591	296	29,236.9300	1319	-126	14,883.6400
17	菜油	-25969		-207,042.6800	5,451.5400	0		0.0000	25969	-540	207,042.6800
18	棕榈油	42387		309,195.9800	27,707.5200	42387	3911	309,195.9800	0		0.0000
19	短纤	14804		55,218.2300	14,277.3300	14804	3761	55,218.2300	0		0.0000
20	花生	-1243	-660	-5,430.2700	-2,867.3500	2332	-67	10,187.7600	3575	593	15,618.0300
21	菜粕	-94828		-241,166.3000	1,097.0700	0		0.0000	94828	1602	241,166.3000
22	PTA	57405		167,108.7700	117,739.4000	57405	10914	167,108.7700	0		0.0000
23	豆油	3648	4523	27,110.1800	38,403.4200	13998	3535	104,026.4000	10350	-988	76,916.2200
24	沪锌	7985		83,234.4700	-39,573.8500	7985	-3608	83,234.4700	0		0.0000

2、摩根大通期货（2024/1/18）

序号	名称	净持仓				多头持仓			空头持仓		
		净持仓	增减	持仓金额(万元)	持仓额变化(万元)	多单量	增减	持仓金额(万元)	空单量	增减	持仓金额(万元)
1	合计	-153040	27180	-2,570,608.8100	154,684.3600	199648	21731	853,129.6400	352688	-13082	3,423,938.4500
2	豆一	-33312		-158,664.6800	-5,553.0000	0		0.0000	33312	1453	158,664.6800
3	沪铝	-229	0	-2,147.6700	-2,147.6700	2755	2755	25,837.6900	2984	2755	27,985.3600
4	豆二	-11869		-44,790.3300	3,218.1500	0		0.0000	11869	-488	44,790.3300
5	国际铜	-84	-408	-2,522.0500	-12,286.0400	224	-240	6,725.4600	308	168	9,247.5100
6	玉米	-981	6590	-2,304.9400	44,535.9700	9573	240	22,492.5900	10554	-8350	24,797.5400
7	玉米淀粉	400		1,130.2700	-10.1100	400	0	1,130.2700	0		0.0000
8	集运指数(欧线)	437		3,813.5800	-223.4000	437	0	3,813.5800	0		0.0000
9	铁矿石	24061		221,121.9800	-5,778.9100	24061	-399	221,121.9800	0		0.0000
10	中证500期货	-7474		-727,916.6500	15,123.2100	0		0.0000	7474	19	727,916.6500
11	沪深300期货	-8513		-530,772.2500	26,823.0300	0		0.0000	8513	155	530,772.2500
12	中证1000期货	-5389		-554,566.6700	12,205.6500	0		0.0000	5389	12	554,566.6700
13	低硫燃料油	5840	2070	24,039.8700	8,547.8000	8157	2173	33,577.6000	2317	103	9,537.7400
14	豆粕	-55040	8915	-167,446.1300	31,072.6100	62772	1821	190,968.9100	117812	-7094	358,415.0400
15	20号胶	3949	111	44,560.6400	1,396.8300	4329	111	48,848.5700	380	0	4,287.9300
16	菜油	-41247		-328,849.3700	-48,259.8400	0		0.0000	41247	200	328,849.3700
17	棕榈油	-12859	7902	-93,801.1900	58,065.2300	10033	4653	73,186.6700	22892	-3249	166,987.8600
18	花生	-11491		-50,200.5000	-8,077.1200	0		0.0000	11491	1909	50,200.5000
19	菜粕	-32988		-83,894.9900	4,036.1200	0		0.0000	32988	-849	83,894.9900
20	橡胶	142		1,959.6300	-7.7000	142	0	1,959.6300	0		0.0000
21	PTA	76765		223,466.6800	31,322.3300	76765	10617	223,466.6800	0		0.0000
22	豆油	-46158		-343,024.0400	661.2100	0		0.0000	46158	174	343,024.0400

数据来源: wind



## ■ 每日热点评论

### 1、双焦J&JM

盘面：今日双焦低位反弹

逻辑：宏观方面，美联储3月降息希望渺茫，降息节点再次被延后；国内方面，一季度降息降准的预期可能落空，2023年全国房地产开发投资110913亿元，比上年下降9.6%，国内地产仍处于衰退状态。产业方面，冬季钢厂检修增多，日均铁水产量下降至220万吨附近，预计钢厂将保持铁水产量低位运行，钢厂对炉料需求大幅下降，双焦或将累库，价格承压。焦炭第二轮提降落地后焦企处于亏损状态，纷纷减产。港口准一级焦现货价格折盘面2550附近。预计双焦价格震荡偏弱运行。

目前估值：中等

建议：偏空。

风险：煤矿事故与安监。

### 2、卷螺HC&RB

盘面：今日螺纹热卷低位反弹，RB2405收于3913，涨1.43%，HC2405收于4030，涨0.93%。

分析：宏观方面，昨夜美国12月零售销售数据大幅好于预期，结合近期美联储官员的鹰派表态，美联储3月降息希望渺茫，降息节点再次被延后；国内方面，一季度降息降准的预期可能落空，2023年全国房地产开发投资110913亿元，比上年下降9.6%，国内地产仍处于衰退状态。产业方面，冬季需求淡季，现货成交较弱，春节后钢材与炉料累库，短期钢材价格承压。但3-6月是钢材消费旺季，市场对旺季需求仍有期待。预计短期钢材价格维持盘整格局。

估值：中等

## 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。

王婧远

期货从业资格：F0288680

投资咨询资格：Z0010907

邮箱：wangjy@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

