



2018年11月29

研发中心

### 一、隔夜基差表

东兴期货		隔夜基差表						
日期	品种	现货	合约	合约价格	隔夜涨跌幅	期货升贴水	升贴水变化	注:
2018/11/28	IF	3178.9	IF1812	3171.4	1.43%	-7.53	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1901	3173.2	1.43%	-5.73	贴水缩窄	
2018/11/28	IC	4441.9	IC1812	4398	1.24%	-43.86	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1901	4382.4	1.44%	-59.46	贴水缩窄	
2018/11/28	IH	2421.1	IH1812	2423.2	1.16%	2.07	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1901	2427	1.07%	5.87	升水缩窄	
2018/11/28	TS	2.6781	TS1812	100.095	0.11%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1903	99.99	0.01%	-	-	
2018/11/28	TF	3.1894	TF1812	98.745	0.05%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1903	98.74	-0.02%	-	-	
2018/11/28	T	3.37	T1812	96.745	0.05%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1903	96.645	0.02%	-	-	
2018/11/27	铁矿	560.66	I1901	471.5	1.29%	-89.16	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I1905	454.5	0.89%	-106.16	贴水缩窄	
2018/11/28	螺纹	3979	RB1901	3644	1.82%	-335.38	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm: 上海, 扣除理计价格
			RB1905	3295	1.51%	-684.38	贴水缩窄	
2018/11/28	LLDPE	9050	L1901	8700	1.75%	-350.00	贴水缩窄	完税自提价(低端价): 线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级): 上海
			L1905	8295	1.78%	-755.00	贴水缩窄	
2018/11/28	PP	8900	PP1901	8782	3.84%	-118.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP1905	8368	3.55%	-532.00	贴水缩窄	
2018/11/28	棕榈油	4140	P1901	4168	0.97%	28.00	升水扩大	交货价: 棕榈油: 天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P1905	4484	0.90%	344.00	升水扩大	
2018/11/28	焦煤	1710	JM1901	1330	1.80%	-380.00	贴水缩窄	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产
			JM1905	1139.5	1.11%	-570.50	贴水缩窄	
2018/11/28	焦炭	2758	J1901	2123	2.07%	-635.06	贴水缩窄	天津港: 平仓价(含税): 一级冶金焦(A<12.5%, <0.65%S, CSR>65%, Mt8%): 山西产, 水分折算后
			J1905	1808.5	0.64%	-949.56	贴水缩窄	
2018/11/28	动力煤	585	ZC901	602.8	0.00%	17.80	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC905	568.6	0.35%	-16.40	贴水缩窄	
2018/11/28	PTA	6125	TA901	6028	2.83%	-97.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA905	5880	2.58%	-245.00	升水扩大	
2018/11/28	MA	2470	MA901	2452	2.68%	-18.00	贴水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA905	2470	1.98%	0.00	贴水扩大	
2018/11/28	橡胶	10200	RU1901	10870	0.98%	670.00	贴水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU1905	11135	1.18%	935.00	贴水扩大	
2018/11/28	豆油	5350	Y1901	5388	0.26%	38.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y1905	5534	0.58%	184.00	升水扩大	
2018/11/28	豆粕	3190	M1901	3056	0.63%	-134.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M1905	2699	1.35%	-491.00	贴水缩窄	
2018/11/28	菜油	6350	O1901	6388	0.36%	38.00	升水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			O1905	6556	0.40%	206.00	升水扩大	
2018/11/28	菜粕	2384	RM901	2198	0.09%	-186.44	贴水缩窄	现货价: 均价: 菜粕
			RM905	2185	0.83%	-199.44	贴水缩窄	

免责声明: 我公司对本表中信息和数据的准确性及完整性不作任何保证。在任何情况下, 表格中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。

## 二、各品种基本面指标

2018/11/29		宏观基本面指标变化		
		隔夜	前一日	变化幅度
资金变动	两市融资余额（亿元）	0.0000	7757.9000	-7757.9000
	沪股通净流入（亿元）	18.3484	1.9116	16.4368
	深股通净流入（亿元）	7.0433	-0.4578	7.5011
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.5526	2.5922	-0.0396
	银行间质押式回购（7天）	2.8632	2.8389	0.0243
	Shibor（1天）	2.5390	2.5560	-0.0170
	Shibor（7天）	2.6500	2.6430	0.0070
二级市场流动性	沪市质押式回购	3.0250	2.7900	0.2350
	深市质押式回购	2.9290	2.2000	0.7290
期指操作建议	上证综指重返2600点，北上资金大幅净流入逾25亿元，期指IF12多单谨持，关注沪深300指数5日均线争夺。			
国债操作建议				
化工操作建议	10月中国进口天然橡胶（包括乳胶、混合胶）共计44.62万吨，环比9月降低10.48%，同比增长3.88%；1-10月累计进口455.78万吨，同比增长3.99%。01沪胶关注11000压制。受制于EIA库存大增和市场对OPEC减产的怀疑，布油失守60美元/桶大关。短线烯烃的基差修复行情或将延续。			
农产品操作建议				

免责声明：本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。本报告版权归东兴期货研发中心所有。未获得东兴期货研发中心书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“东兴期货研发中心”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。