

2019年10月14日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货 投资咨询部		隔夜基差表						注:
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	
2019/10/11	IF	3911.7	IF1910	3913.4	1.28%	1.67	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1911	3913.6	1.35%	1.87	升水扩大	
2019/10/11	IC	5055.5	IC1910	5055.6	0.65%	0.08	升水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1911	5012.4	0.64%	-43.12	贴水缩窄	
2019/10/11	IH	2983.1	IH1910	2980.4	1.70%	-2.72	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1911	2976.6	1.70%	-6.52	贴水缩窄	
2019/10/12	TS	2.6907	TS1912	100.24	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.11	-0.04%	-	-	
2019/10/12	TF	3.0466	TF1912	99.685	-0.13%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.47	-0.11%	-	-	
2019/10/12	T	3.1716	T1912	98.08	-0.24%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.755	-0.24%	-	-	
2019/10/10	铁矿	812.05	I2001	658	0.08%	-154.05	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	580	0.52%	-232.05	贴水缩窄	
2019/10/12	螺纹	3876	RB2001	3407	-0.23%	-469.29	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3231	-0.25%	-645.29	贴水扩大	
2019/10/12	LLDPE	7400	L2001	7430	0.61%	30.00	升水缩窄	完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海
			L2005	7290	0.34%	-110.00	贴水扩大	
2019/10/12	PP	8700	PP2001	8162	0.50%	-538.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2005	7778	0.46%	-922.00	贴水扩大	
2019/10/11	棕榈油	4750	P2001	4826	0.71%	76.00	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
			P2005	5118	0.95%	368.00	升水扩大	
2019/10/12	焦煤	1710	JM2001	1250	-0.28%	-460.00	贴水扩大	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM2005	1185	0.00%	-525.00	贴水扩大	
2019/10/12	焦炭	2145	J2001	1862	0.22%	-283.16	贴水扩大	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
			J2005	1810	0.28%	-335.16	贴水扩大	
2019/10/12	动力煤	584	ZC001	565.6	-0.25%	-18.40	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC005	555.4	-0.25%	-28.60	贴水扩大	
2019/10/12	PTA	5130	TA001	5102	-0.97%	-28.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	5070	-0.71%	-60.00	升水缩窄	
2019/10/12	MA	2260	MA001	2325	-1.65%	65.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA005	2268	-0.92%	8.00	升水缩窄	
2019/10/11	橡胶	10700	RU2001	11615	-0.04%	915.00	贴水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2005	11800	0.00%	1100.00	贴水扩大	
2019/10/12	豆油	5880	Y2001	6044	0.90%	164.00	贴水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2005	6104	0.59%	224.00	贴水扩大	
2019/10/12	豆粕	3150	M2001	2989	1.08%	-161.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M2005	2989	1.08%	-161.00	贴水扩大	
2019/10/12	菜油	7570	OI001	7319	0.37%	-251.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			OI005	7277	0.37%	-293.00	贴水扩大	
2019/10/12	菜粕	2423	RM001	2377	0.93%	-45.78	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM005	2418	1.17%	-4.78	贴水扩大	

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

 东兴期货 投资咨询部 2019/10/14		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）	9601.1500	9568.9800	32.1700
	沪股通净流入（亿元）	27.3135	1.5668	25.7467
	深股通净流入（亿元）	9.9479	-0.2035	10.1514
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.2187	1.9170	0.3017
	银行间质押式回购（7天）	2.5049	2.4345	0.0704
	Shibor（1天）	2.2150	1.9110	0.3040
	Shibor（7天）	2.5910	2.5560	0.0350
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8800	2.9950	-0.1150
	深市质押式回购	2.5120	2.4500	0.0620
期指操作建议	中美贸易关系改善，全球流动性宽松预期加强，提振市场风险偏好，期指IC10多单持有。			
期债操作建议	避险情绪下降，利率债多单暂避，期债T12关注98.00平台争夺。			
化工品操作建议	节后需求不及预期，沥青或承压。			
农产品操作建议	白糖仍处于阶段性供给紧缺状态，10月下旬关注新糖上市节奏和价格，SR2003预计运行区间5450-5600元/吨。			
备注：两融余额由于更新时间影响，采用前日数据代替隔夜数据。				

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投资咨询部所有。未获得东兴期货投资咨询部书面授权，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“东兴期货投资咨询部”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。