

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 DONGXING FUTURES		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:
2019/10/14	IF	3953.2	IF1910	3945.2	0.81%	-8.04	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1911	3946.8	0.85%	-6.44	贴水扩大	
2019/10/14	IC	5131.1	IC1910	5103	0.94%	-28.13	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1911	5063.8	1.03%	-67.33	贴水扩大	
2019/10/14	IH	3013.5	IH1910	3007	0.89%	-6.53	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1911	3008.2	1.06%	-5.33	贴水缩窄	
2019/10/14	TS	2.7023	TS1912	100.245	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.11	0.00%	-	-	
2019/10/14	TF	3.0467	TF1912	99.695	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.425	-0.05%	-	-	
2019/10/14	T	3.1641	T1912	98.15	0.07%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.76	0.01%	-	-	
2019/10/11	铁矿	806.68	I2001	638.5	-2.96%	-168.18	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石: 62%品位: 干基粉矿含税价
			I2005	564	-2.76%	-242.68	贴水缩窄	
2019/10/14	螺纹	3876	RB2001	3352	-1.61%	-524.29	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢: HRB400 20mm: 上海, 扣除理计价格
			RB2005	3201	-0.93%	-675.29	贴水扩大	
2019/10/14	LLDPE	7500	L2001	7520	1.21%	20.00	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	7385	1.30%	-115.00	贴水扩大	
2019/10/14	PP	8850	PP2001	8262	1.23%	-588.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7856	1.00%	-994.00	贴水扩大	
2019/10/14	棕榈油	4650	P2001	4682	-2.98%	32.00	升水缩窄	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	4980	-2.70%	330.00	升水缩窄	
2019/10/14	焦煤	1710	JM2001	1233	-1.36%	-477.00	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	1174.5	-0.89%	-535.50	贴水扩大	
2019/10/14	焦炭	2145	J2001	1805	-3.06%	-340.16	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	1769	-2.27%	-376.16	贴水扩大	
2019/10/14	动力煤	584	ZC001	561.8	-0.67%	-22.20	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	552.4	-0.54%	-31.60	贴水扩大	
2019/10/14	PTA	5130	TA001	5120	0.35%	-10.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	5096	0.51%	-34.00	升水扩大	
2019/10/14	MA	2210	MA001	2289	-1.55%	79.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2259	-0.40%	49.00	升水扩大	
2019/10/14	橡胶	10700	RU2001	11695	0.69%	995.00	贴水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	11880	0.68%	1180.00	升水缩窄	
2019/10/14	豆油	5830	Y2001	5914	-2.15%	84.00	升水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	5982	-2.00%	152.00	升水缩窄	
2019/10/14	豆粕	3150	M2001	2969	-0.67%	-181.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	2969	-0.67%	-181.00	贴水扩大	
2019/10/14	菜油	7500	OI001	7201	-1.61%	-299.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7153	-1.70%	-347.00	贴水扩大	
2019/10/14	菜粕	2418	RM001	2349	-1.18%	-69.33	贴水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2384	-1.41%	-34.33	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		2019/10/15		宏观基本面指标变化	
资金变动		隔夜	前一日	变化幅度	
	两市融资余额（亿元）	9581.2400	9601.1500	-19.9100	
	沪股通净流入（亿元）	5.1971	27.3135	-22.1164	
	深股通净流入（亿元）	21.8192	9.9479	11.8713	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6115	2.2187	0.3928	
	银行间质押式回购（7天）	2.7146	2.5049	0.2097	
	Shibor（1天）	2.5550	2.2150	0.3400	
	Shibor（7天）	2.6510	2.5910	0.0600	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7350	2.8800	-0.1450	
	深市质押式回购	1.6000	2.5120	-0.9120	
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，今日公布9月通胀数据，定向降准今日实施，共释放资金500亿元，期指IC10多单持有。				
化工品操作建议	商社事件致现货偏紧，沪胶或震荡向上。				
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。