

2019年10月17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						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	
2019/10/16	IF	3922.7	IF1910	3917.8	-0.43%	-4.89	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1911	3914	-0.46%	-8.69	贴水扩大	
2019/10/16	IC	5038.4	IC1910	5021	-0.61%	-17.36	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1911	4976	-0.68%	-62.36	贴水扩大	
2019/10/16	IH	3004.7	IH1910	2999.4	-0.39%	-5.32	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1911	2994.4	-0.45%	-10.32	贴水扩大	
2019/10/16	TS	2.7258	TS1912	100.25	-0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.115	0.00%	-	-	
2019/10/16	TF	3.0074	TF1912	99.695	-0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.425	-0.04%	-	-	
2019/10/16	T	3.1693	T1912	98.095	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.735	-0.06%	-	-	
2019/10/15	铁矿	791.02	I2001	617	-4.19%	-174.02	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	560	-2.78%	-231.02	贴水缩窄	
2019/10/16	螺纹	3825	RB2001	3291	-1.64%	-533.74	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3189	-0.44%	-635.74	贴水缩窄	
2019/10/16	LLDPE	7400	L2001	7310	-1.88%	-90.00	贴水扩大	完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海
			L2005	7205	-1.77%	-195.00	贴水扩大	
2019/10/16	PP	8850	PP2001	8100	-1.15%	-750.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2005	7726	-1.09%	-1124.00	贴水扩大	
2019/10/16	棕榈油	4740	P2001	4810	2.73%	70.00	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	5076	1.93%	336.00	升水缩窄	
2019/10/16	焦煤	1710	JM2001	1217	-2.01%	-493.00	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	1155	-1.66%	-555.00	贴水扩大	
2019/10/16	焦炭	2145	J2001	1777	-1.80%	-368.16	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	1747.5	-1.35%	-397.66	贴水扩大	
2019/10/16	动力煤	582	ZC001	557	-0.36%	-25.00	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC005	548.8	-0.18%	-33.20	贴水缩窄	
2019/10/16	PTA	5025	TA001	5006	-0.16%	-19.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	5026	0.08%	1.00	升水扩大	
2019/10/16	MA	2115	MA001	2206	-2.99%	91.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA005	2200	-2.57%	85.00	升水扩大	
2019/10/16	橡胶	10700	RU2001	11530	0.00%	830.00	贴水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2005	11710	-0.13%	1010.00	升水缩窄	
2019/10/16	豆油	5860	Y2001	6000	1.25%	140.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2005	6064	1.24%	204.00	升水扩大	
2019/10/16	豆粕	3180	M2001	2970	-0.10%	-210.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M2005	2970	-0.10%	-210.00	贴水缩窄	
2019/10/16	菜油	7460	OI001	7210	0.54%	-250.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			OI005	7164	0.46%	-296.00	贴水缩窄	
2019/10/16	菜粕	2413	RM001	2354	0.13%	-59.33	贴水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM005	2388	0.17%	-25.33	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

 东兴期货 投资咨询部 2019/10/17		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）	9635.7900	9650.6900	-14.9000
	沪股通净流入（亿元）	7.0277	26.9693	-19.9416
	深股通净流入（亿元）	20.3365	9.7432	10.5933
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.7429	2.7625	-0.0196
	银行间质押式回购（7天）	2.8624	2.8519	0.0105
	Shibor（1天）	2.6940	2.7030	-0.0090
	Shibor（7天）	2.6860	2.6840	0.0020
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7100	2.6950	0.0150
	深市质押式回购	2.7420	2.4000	0.3420
期指操作建议	明日期指交割，注意移仓，指数缺乏上行动力或维持高位震荡，谨慎者期指IC10多单暂避。			
化工品操作建议	泰国政府通过242.78亿泰铢胶农补助计划，沪胶或区间震荡，01沪胶关注11600压制。			
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。