

2019年10月18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	
2019/10/17	IF	3925.2	IF1910	3926.8	0.23%	1.58	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1911	3924.6	0.27%	-0.62	贴水缩窄	
2019/10/17	IC	5029.9	IC1910	5028.2	0.14%	-1.65	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1911	4973	-0.06%	-56.85	贴水缩窄	
2019/10/17	IH	3011.8	IH1910	3010.4	0.37%	-1.35	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1911	3007.6	0.44%	-4.15	贴水缩窄	
2019/10/17	TS	2.7234	TS1912	100.285	0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.14	0.02%	-	-	
2019/10/17	TF	3.0003	TF1912	99.79	0.10%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.49	0.07%	-	-	
2019/10/16	T	3.1693	T1912	98.31	0.22%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.93	0.20%	-	-	
2019/10/16	铁矿	778.12	I2001	615	-0.32%	-163.12	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	557.5	-0.45%	-220.62	贴水扩大	
2019/10/17	螺纹	3784	RB2001	3324	1.00%	-459.51	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3203	0.44%	-580.51	贴水缩窄	
2019/10/17	LLDPE	7250	L2001	7295	-0.21%	45.00	升水扩大	完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海
			L2005	7205	0.00%	-45.00	贴水缩窄	
2019/10/17	PP	8750	PP2001	8075	-0.31%	-675.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2005	7696	-0.39%	-1054.00	贴水缩窄	
2019/10/17	棕榈油	4770	P2001	4800	-0.21%	30.00	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	5078	0.04%	308.00	升水缩窄	
2019/10/17	焦煤	1710	JM2001	1236.5	1.60%	-473.50	贴水缩窄	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM2005	1168	1.13%	-542.00	贴水缩窄	
2019/10/17	焦炭	2145	J2001	1788	0.62%	-357.16	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
			J2005	1749.5	0.11%	-395.66	贴水缩窄	
2019/10/17	动力煤	581	ZC001	558.4	0.25%	-22.60	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC005	550.2	0.26%	-30.80	贴水缩窄	
2019/10/17	PTA	4970	TA001	4978	-0.56%	8.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4986	-0.80%	16.00	升水缩窄	
2019/10/17	MA	2105	MA001	2198	-0.36%	93.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA005	2195	-0.23%	90.00	升水扩大	
2019/10/17	橡胶	10700	RU2001	11565	0.30%	865.00	贴水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2005	11760	0.43%	1060.00	升水扩大	
2019/10/17	豆油	5900	Y2001	6032	0.53%	132.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2005	6066	0.03%	166.00	升水缩窄	
2019/10/17	豆粕	3170	M2001	2968	-0.07%	-202.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M2005	2968	-0.07%	-202.00	贴水缩窄	
2019/10/17	菜油	7480	OI001	7211	0.01%	-269.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			OI005	7168	0.06%	-312.00	贴水扩大	
2019/10/17	菜粕	2413	RM001	2350	-0.17%	-63.33	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM005	2386	-0.08%	-27.33	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 2019/10/18		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）	9645.2665	9635.7900
	沪股通净流入（亿元）	2.0139	7.0277	-5.0138
	深股通净流入（亿元）	15.3740	20.3365	-4.9625
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6247	2.7429	-0.1182
	银行间质押式回购（7天）	2.7845	2.8624	-0.0779
	Shibor（1天）	2.5850	2.6940	-0.1090
	Shibor（7天）	2.6630	2.6860	-0.0230
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.6400	2.7100	-0.0700
	深市质押式回购	1.8000	2.7420	-0.9420
期指操作建议	今日期指交割，注意移仓，北向资金连续6日净流入，两市缩量成交，谨慎者期指多单暂避。			
化工品操作建议	橡胶在此位置下上下两难，或延续低位震荡。			
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。