



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年10月24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

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:
2019/10/23	IF	3871.1	IF1911	3862.8	-0.41%	-8.28	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1912	3856.2	-0.48%	-14.88	贴水缩窄	
2019/10/23	IC	4967.2	IC1911	4923	-0.64%	-44.19	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1912	4875	-0.64%	-92.19	贴水缩窄	
2019/10/23	IH	2954.3	IH1911	2947.8	-0.65%	-6.51	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1912	2942.6	-0.69%	-11.71	贴水扩大	
2019/10/23	TS	2.724	TS1912	100.185	0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.045	0.02%	-	-	
2019/10/23	TF	3.0266	TF1912	99.575	0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.305	0.08%	-	-	
2019/10/23	T	3.2122	T1912	97.875	0.12%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.475	0.11%	-	-	
2019/10/23	铁矿	753.81	I2001	620.5	0.73%	-133.31	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	0.63%	-196.81	贴水扩大	
2019/10/23	螺纹钢	3784	RB2001	3312	-0.18%	-471.51	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢: HRB400 20mm: 上海, 扣除理计价格
			RB2005	3189	-0.09%	-594.51	贴水扩大	
2019/10/23	LLDPE	7300	L2001	7320	0.83%	20.00	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	7215	0.63%	-85.00	贴水扩大	
2019/10/23	PP	8700	PP2001	8063	0.24%	-637.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7693	0.33%	-1007.00	贴水缩窄	
2019/10/23	棕榈油	4900	P2001	4920	1.53%	20.00	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	5198	1.52%	298.00	升水缩窄	
2019/10/23	焦煤	1710	JM2001	1252	0.97%	-458.00	贴水缩窄	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8% S, G80): 河北产
			JM2005	1186	0.81%	-524.00	贴水缩窄	
2019/10/23	焦炭	2094	J2001	1770.5	1.26%	-323.59	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	1745.5	1.13%	-348.59	贴水缩窄	
2019/10/23	动力煤	575	ZC001	556.8	-0.36%	-18.20	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	548.6	-0.22%	-26.40	贴水扩大	
2019/10/23	PTA	4900	TA001	4880	0.33%	-20.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4900	0.16%	0.00	升水扩大	
2019/10/23	MA	2040	MA001	2122	-1.44%	82.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2177	-0.14%	137.00	升水扩大	
2019/10/23	橡胶	11150	RU2001	11840	-0.04%	690.00	#VALUE!	市场价: 天然橡胶: 云南国富全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	12025	-0.04%	875.00	升水扩大	
2019/10/23	豆油	6020	Y2001	6084	0.70%	64.00	升水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6094	0.63%	74.00	升水缩窄	
2019/10/23	豆粕	3210	M2001	3052	-0.23%	-158.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	3052	-0.23%	-158.00	贴水缩窄	
2019/10/23	菜油	7500	OI001	7218	0.47%	-282.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7176	0.52%	-324.00	贴水扩大	
2019/10/23	菜粕	2422	RM001	2392	-0.21%	-29.67	贴水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2428	-0.04%	6.33	升水扩大	

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。

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		2019/10/24		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）	9623.6000	9614.3400	9.2600	
	沪股通净流入（亿元）	-12.6854	3.6621	-16.3475	
	深股通净流入（亿元）	-5.3603	-0.7136	-4.6467	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.7029	2.8738	-0.1709	
	银行间质押式回购（7天）	2.9583	3.0357	-0.0774	
	Shibor（1天）	2.6540	2.7990	-0.1450	
	Shibor（7天）	2.6930	2.7890	-0.0960	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8850	2.9200	-0.0350	
	深市质押式回购	2.7700	2.8810	-0.1110	
期指操作建议	北向资金净流出，两市成交偏弱，谨慎者期指IC11多单暂避				
黑色操作建议	建材成交良好，螺纹01区间震荡，关注支撑点位3300				
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。