



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年10月29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:
2019/10/28	IF	3926.6	IF1911	3919	0.51%	-7.59	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1912	3917.6	0.48%	-8.99	贴水扩大	
2019/10/28	IC	5084.5	IC1911	5046.4	1.45%	-38.07	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1912	4998.8	1.42%	-85.67	贴水扩大	
2019/10/28	IH	2981.4	IH1911	2978.8	0.38%	-2.56	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1912	2976.2	0.38%	-5.16	贴水扩大	
2019/10/28	TS	2.7261	TS1912	100.105	-0.07%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	99.97	-0.07%	-	-	
2019/10/28	TF	3.0633	TF1912	99.415	-0.11%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.145	-0.10%	-	-	
2019/10/28	T	3.2924	T1912	97.42	-0.27%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.025	-0.29%	-	-	
2019/10/24	铁矿	756.31	I2001	627	-1.18%	-129.31	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	566	-0.70%	-190.31	贴水缩窄	
2019/10/28	螺纹	3804	RB2001	3327	-0.51%	-477.12	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3202	-0.25%	-602.12	贴水扩大	
2019/10/28	LLDPE	7300	L2001	7305	0.00%	5.00	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	-0.14%	-95.00	贴水扩大	
2019/10/28	PP	8700	PP2001	8028	-0.71%	-672.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7708	-0.01%	-992.00	贴水扩大	
2019/10/28	棕榈油	5100	P2001	5150	1.62%	50.00	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	5392	1.39%	292.00	升水缩窄	
2019/10/28	焦煤	1710	JM2001	1248	-0.76%	-462.00	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	1178.5	-0.97%	-531.50	贴水扩大	
2019/10/25	焦炭	2094	J2001	1747.5	-2.56%	-346.59	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	1725	-2.27%	-369.09	贴水缩窄	
2019/10/28	动力煤	572	ZC001	562.4	0.43%	-9.60	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	550.8	0.18%	-21.20	贴水缩窄	
2019/10/28	PTA	4850	TA001	4818	-1.95%	-32.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4846	-1.46%	-4.00	升水缩窄	
2019/10/28	MA	2005	MA001	2086	0.38%	81.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2153	0.23%	148.00	升水扩大	
2019/10/28	橡胶	11125	RU2001	11710	-1.22%	585.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	11905	-1.20%	780.00	升水扩大	
2019/10/28	豆油	6100	Y2001	6236	0.81%	136.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6162	0.46%	62.00	升水扩大	
2019/10/28	豆粕	3210	M2001	2982	-2.10%	-228.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	2982	-2.10%	-228.00	贴水扩大	
2019/10/28	菜油	7560	OI001	7315	0.52%	-245.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7252	0.58%	-308.00	贴水缩窄	
2019/10/28	菜粕	2381	RM001	2322	-1.15%	-59.11	贴水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2368	-1.29%	-13.11	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 DONGXING FUTURES 投资咨询部		2019/10/29		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）	9641.8900	9640.4700	1.4200	
	沪股通净流入（亿元）	15.7954	0.0628	15.7326	
	深股通净流入（亿元）	12.6016	15.3139	-2.7123	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.5202	2.5469	-0.0267	
	银行间质押式回购（7天）	2.8765	2.9115	-0.0350	
	Shibor（1天）	2.4780	2.5060	-0.0280	
	Shibor（7天）	2.6710	2.6690	0.0020	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.9000	2.8300	0.0700	
	深市质押式回购	2.6500	2.9000	-0.2500	
期指操作建议	昨日北向资金净流入，两市成交增加，谨慎者可持续观望，关注政策信号。				
黑色操作建议	建材成交22万吨，现货需求较好，基差有所修复，螺纹01前多谨持。				
化工操作建议	产期价格企稳但华东地区供需疲弱，MA01谨慎观望，关注2000企稳后的做多机会。沪胶冲高回落，或为情绪拐点，01沪胶关注11500支撑。				
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。