



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年10月30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:
2019/10/29	IF	3910.2	IF1911	3905	-0.36%	-5.23	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1912	3903	-0.37%	-7.23	贴水缩窄	
2019/10/29	IC	5007.7	IC1911	4979.6	-1.32%	-28.11	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1912	4935	-1.28%	-72.71	贴水缩窄	
2019/10/29	IH	2968.3	IH1911	2969.8	-0.30%	1.52	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1912	2965.8	-0.35%	-2.48	贴水缩窄	
2019/10/29	TS	2.7466	TS1912	100.075	-0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	99.94	-0.03%	-	-	
2019/10/29	TF	3.0839	TF1912	99.405	-0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.105	-0.04%	-	-	
2019/10/29	T	3.3029	T1912	97.42	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.015	-0.01%	-	-	
2019/10/29	铁矿	736.54	I2001	622	-0.80%	-114.54	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	563.5	-0.44%	-173.04	贴水缩窄	
2019/10/29	螺纹	3814	RB2001	3348	0.63%	-466.43	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3216	0.44%	-598.43	贴水缩窄	
2019/10/29	LLDPE	7300	L2001	7270	-0.48%	-30.00	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	7185	-0.28%	-115.00	贴水扩大	
2019/10/29	PP	8600	PP2001	7973	-0.69%	-627.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7655	-0.69%	-945.00	贴水缩窄	
2019/10/29	棕榈油	5080	P2001	5120	-0.58%	40.00	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	5382	-0.19%	302.00	升水扩大	
2019/10/29	焦煤	1710	JM2001	1259	0.88%	-451.00	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	0.64%	-524.00	贴水缩窄	
2019/10/29	焦炭	2094	J2001	1758	0.60%	-336.09	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	1725.5	0.03%	-368.59	贴水缩窄	
2019/10/29	动力煤	570	ZC001	556.2	-1.10%	-13.80	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	547.2	-0.65%	-22.80	贴水扩大	
2019/10/29	PTA	4850	TA001	4838	0.42%	-12.00	贴水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4866	0.41%	16.00	贴水扩大	
2019/10/29	MA	2025	MA001	2099	0.62%	74.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2161	0.37%	136.00	升水缩窄	
2019/10/29	橡胶	10950	RU2001	11790	0.68%	840.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	11970	0.55%	1020.00	升水扩大	
2019/10/29	豆油	6220	Y2001	6202	-0.55%	-18.00	贴水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6162	0.00%	-58.00	贴水扩大	
2019/10/29	豆粕	3200	M2001	2988	0.20%	-212.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	2988	0.20%	-212.00	贴水缩窄	
2019/10/29	菜油	7560	OI001	7316	0.01%	-244.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7241	-0.15%	-319.00	贴水扩大	
2019/10/29	菜粕	2386	RM001	2324	0.09%	-62.11	贴水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2369	0.04%	-17.11	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 投资咨询部		2019/10/30		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）	9699.3300	9641.8900	57.4400	
	沪股通净流入（亿元）	8.8855	15.7954	-6.9099	
	深股通净流入（亿元）	15.3508	12.6016	2.7492	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.4074	2.5202	-0.1128	
	银行间质押式回购（7天）	2.8636	2.8765	-0.0129	
	Shibor（1天）	2.3680	2.4780	-0.1100	
	Shibor（7天）	2.6700	2.6710	-0.0010	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.9650	2.9000	0.0650	
	深市质押式回购	2.5870	2.6500	-0.0630	
期指操作建议	北向资金持续净流入，A股震荡走低，期指多单暂避，关注凌晨美联储利率决议。				
黑色操作建议	建材成交21.74万吨，进口煤停止报关，螺纹01前多谨持。				
化工操作建议	供应压力逐步凸显，PP短线或弱于L。沪胶以震荡思路对待，关注库存变化。				
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。