



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年10月31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:
2019/10/30	IF	3891.2	IF1911	3877	-0.72%	-14.23	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1912	3871.6	-0.80%	-19.63	贴水扩大	
2019/10/30	IC	4947.9	IC1911	4916	-1.28%	-31.90	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1912	4871	-1.30%	-76.90	贴水扩大	
2019/10/30	IH	2952.1	IH1911	2949.8	-0.67%	-2.32	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1912	2947.8	-0.61%	-4.32	贴水扩大	
2019/10/30	TS	2.7773	TS1912	99.96	-0.11%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	99.815	-0.13%	-	-	
2019/10/30	TF	3.1239	TF1912	99.225	-0.18%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	98.915	-0.19%	-	-	
2019/10/30	T	3.3125	T1912	97.11	-0.32%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	96.68	-0.35%	-	-	
2019/10/30	铁矿	730.76	I2001	622.5	0.08%	-108.26	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	568	0.80%	-162.76	贴水缩窄	
2019/10/30	螺纹	3825	RB2001	3373	0.75%	-451.74	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3228	0.37%	-596.74	贴水缩窄	
2019/10/30	LLDPE	7300	L2001	7270	0.00%	-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	7170	-0.21%	-130.00	贴水扩大	
2019/10/30	PP	8600	PP2001	7975	0.03%	-625.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7650	-0.07%	-950.00	贴水扩大	
2019/10/30	棕榈油	5220	P2001	5220	1.95%	0.00	贴水扩大	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	5472	1.67%	252.00	升水缩窄	
2019/10/30	焦煤	1710	JM2001	1260.5	0.12%	-449.50	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	1174	-1.01%	-536.00	贴水扩大	
2019/10/30	焦炭	2094	J2001	1744.5	-0.77%	-349.59	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	1715.5	-0.58%	-378.59	贴水扩大	
2019/10/30	动力煤	569	ZC001	556.6	0.07%	-12.40	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	548.8	0.29%	-20.20	贴水缩窄	
2019/10/30	PTA	4860	TA001	4836	-0.04%	-24.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4844	-0.45%	-16.00	升水缩窄	
2019/10/30	MA	2020	MA001	2105	0.29%	85.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2167	0.28%	147.00	升水扩大	
2019/10/30	橡胶	11100	RU2001	11955	1.40%	855.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	12125	1.29%	1025.00	升水扩大	
2019/10/30	豆油	6270	Y2001	6256	0.87%	-14.00	贴水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6212	0.81%	-58.00	贴水扩大	
2019/10/30	豆粕	3180	M2001	2989	0.03%	-191.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	2989	0.03%	-191.00	贴水缩窄	
2019/10/30	菜油	7680	OI001	7400	1.15%	-280.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7314	1.01%	-366.00	贴水扩大	
2019/10/30	菜粕	2386	RM001	2323	-0.04%	-63.11	贴水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2372	0.13%	-14.11	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 DONGXING FUTURES 投资咨询部		2019/10/31		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）	9690.4000	9699.3300	-8.9300	
	沪股通净流入（亿元）	6.3787	8.8855	-2.5068	
	深股通净流入（亿元）	22.6166	15.3508	7.2658	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.3520	2.4074	-0.0554	
	银行间质押式回购（7天）	2.8267	2.8636	-0.0369	
	Shibor（1天）	2.3030	2.3680	-0.0650	
	Shibor（7天）	2.6830	2.6700	0.0130	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8700	2.9650	-0.0950	
	深市质押式回购	2.1600	2.5870	-0.4270	
期指操作建议	今日公布10月PMI数据，美联储如期降息，美国三大股指全线收涨，期指IC11或轻仓试多。				
黑色操作建议	河北启动重污染II级应急响应，螺纹01轻仓试多。				
化工操作建议	沪胶大幅反弹站上12000，但整体基本面并无支撑，等待中长线回调买入机会。				
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。