



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019 年 11 月 1 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:
2019/10/31	IF	3886.8	IF1911	3879	0.05%	-7.75	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1912	3873.8	0.06%	-12.95	贴水缩窄	
2019/10/31	IC	4917.4	IC1911	4892.8	-0.47%	-24.62	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1912	4851	-0.41%	-66.42	贴水缩窄	
2019/10/31	IH	2954.7	IH1911	2956.2	0.22%	1.47	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1912	2952.8	0.17%	-1.93	贴水缩窄	
2019/10/31	TS	2.7664	TS1912	100.095	0.14%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	99.935	0.12%	-	-	
2019/10/31	TF	3.081	TF1912	99.395	0.17%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.03	0.12%	-	-	
2019/10/31	T	3.288	T1912	97.485	0.39%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.02	0.35%	-	-	
2019/10/31	铁矿	727.79	I2001	620.5	-0.32%	-107.29	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	565	-0.53%	-162.79	贴水扩大	
2019/10/31	螺纹	3845	RB2001	3367	-0.18%	-478.36	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3218	-0.31%	-627.36	贴水扩大	
2019/10/31	LLDPE	7300	L2001	7290	0.28%	-10.00	贴水缩窄	完税自提价(低端价): 线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级): 上海
			L2005	7190	0.28%	-110.00	贴水缩窄	
2019/10/31	PP	8600	PP2001	7944	-0.39%	-656.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7630	-0.26%	-970.00	贴水扩大	
2019/10/31	棕榈油	5180	P2001	5216	-0.08%	36.00	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	5438	-0.62%	258.00	升水扩大	
2019/10/31	焦煤	1710	JM2001	1236	-1.94%	-474.00	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	1152	-1.87%	-558.00	贴水扩大	
2019/10/31	焦炭	2094	J2001	1737.5	-0.40%	-356.59	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	1704	-0.67%	-390.09	贴水扩大	
2019/10/31	动力煤	567	ZC001	543.6	-2.34%	-23.40	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	540	-1.60%	-27.00	贴水扩大	
2019/10/31	PTA	4860	TA001	4842	0.12%	-18.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4848	0.08%	-12.00	升水缩窄	
2019/10/31	MA	2025	MA001	2101	-0.19%	76.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2165	-0.09%	140.00	升水缩窄	
2019/10/31	橡胶	11200	RU2001	12015	0.50%	815.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	12135	0.08%	935.00	升水扩大	
2019/10/31	豆油	6270	Y2001	6230	-0.42%	-40.00	贴水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6182	-0.48%	-88.00	贴水扩大	
2019/10/31	豆粕	3180	M2001	2956	-1.10%	-224.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	2956	-1.10%	-224.00	贴水扩大	
2019/10/31	菜油	7680	OI001	7393	-0.09%	-287.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7278	-0.49%	-402.00	贴水扩大	
2019/10/31	菜粕	2382	RM001	2292	-1.33%	-89.67	贴水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2344	-1.18%	-37.67	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		2019/11/1		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）	9687.8000	9690.4000	-2.6000	
	沪股通净流入（亿元）	31.8940	6.3787	25.5153	
	深股通净流入（亿元）	41.9992	22.6166	19.3826	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6715	2.3520	0.3195	
	银行间质押式回购（7天）	2.8263	2.8267	-0.0004	
	Shibor（1天）	2.5900	2.3030	0.2870	
	Shibor（7天）	2.6850	2.6830	0.0020	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.5550	2.8700	-0.3150	
	深市质押式回购	1.4900	2.1600	-0.6700	
期指操作建议	10月制造业PMI有所回落，昨日北向资金逆势净流入73.9亿元，两市缩量成交，谨慎者期指持续多单暂避。				
黑色操作建议	昨日建材成交20.4万吨，本周螺纹总库存372.17吨，山东启动重污染II级响应，螺纹01轻仓试多。				
化工操作建议	天胶价格抬升后需求受到抑制，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。