



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年11月7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:
2019/11/06	IF	3984.9	IF1911	3983	-0.34%	-1.88	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1912	3980.2	-0.35%	-4.68	贴水缩窄	
2019/11/06	IC	4974.7	IC1911	4955.4	-0.86%	-19.33	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1912	4908.2	-0.91%	-66.53	贴水缩窄	
2019/11/06	IH	3032.8	IH1911	3030	-0.21%	-2.79	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1912	3029.2	-0.18%	-3.59	贴水缩窄	
2019/11/06	TS	2.7757	TS1912	100.22	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.07	-0.03%	-	-	
2019/11/06	TF	3.0655	TF1912	99.58	0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.31	0.07%	-	-	
2019/11/06	T	3.2555	T1912	97.855	0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.47	0.13%	-	-	
2019/11/05	铁矿	718.98	I2001	621.5	-0.08%	-97.48	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石: 62%品位: 干基粉矿含税价
			I2005	567	-0.18%	-151.98	贴水缩窄	
2019/11/06	螺纹	3907	RB2001	3441	0.20%	-466.22	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢: HRB400 20mm: 上海, 扣除理计价格
			RB2005	3252	-0.06%	-655.22	贴水扩大	
2019/11/06	LLDPE	7300	L2001	7235	-0.34%	-65.00	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	7160	-0.35%	-140.00	贴水扩大	
2019/11/06	PP	8600	PP2001	8008	-0.17%	-592.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7631	-0.38%	-969.00	贴水扩大	
2019/11/06	棕榈油	5390	P2001	5382	-0.41%	-8.00	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	5550	-1.03%	160.00	升水缩窄	
2019/11/06	焦煤	1710	JM2001	1234	-1.08%	-476.00	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	1141.5	-0.57%	-568.50	贴水扩大	
2019/11/06	焦炭	2043	J2001	1749	-0.85%	-294.01	贴水扩大	天津港: 平仓价(含税): 一级冶金焦
			J2005	1684.5	-0.38%	-358.51	贴水扩大	(A<12.5%, <0.65% S, CSR>65%, Mt8%): 山西产, 水分折算后
2019/11/06	动力煤	557	ZC001	543.6	-0.44%	-13.40	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	537.8	-0.26%	-19.20	贴水缩窄	
2019/11/06	PTA	4845	TA001	4792	-1.24%	-53.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4842	-0.82%	-3.00	贴水扩大	
2019/11/06	MA	2005	MA001	2075	-2.21%	70.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2152	-1.51%	147.00	升水扩大	
2019/11/06	橡胶	11350	RU2001	12110	-0.74%	760.00	#VALUE!	市场价: 天然橡胶: 云南国富全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	12275	-0.77%	925.00	升水扩大	
2019/11/06	豆油	6480	Y2001	6350	-0.44%	-130.00	贴水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6276	-0.82%	-204.00	贴水扩大	
2019/11/06	豆粕	3140	M2001	2921	-1.42%	-219.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M2005	2921	-1.42%	-219.00	贴水扩大	
2019/11/06	菜油	7690	OI001	7444	-1.57%	-246.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7287	-1.89%	-403.00	贴水缩窄	
2019/11/06	菜粕	2354	RM001	2234	-1.54%	-120.44	贴水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2303	-1.62%	-51.44	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 2019/11/7		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）	9708.1300	9690.5100	17.6200
	沪股通净流入（亿元）	9.2198	31.6863	-22.4665
	深股通净流入（亿元）	-1.3091	20.3185	-21.6276
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.8322	1.9198	-0.0876
	银行间质押式回购（7天）	2.4829	2.5211	-0.0382
	Shibor（1天）	1.7880	1.8800	-0.0920
	Shibor（7天）	2.5460	2.4980	0.0480
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.0000	2.1800	-0.1800
	深市质押式回购	1.8010	1.8600	-0.0590
期指操作建议	昨日北向资金持续净流入，期指贴水收窄，期指前多续持，关注10月通胀数据。			
黑色操作建议	建材成交21.74万吨，唐山解除II级应急响应，螺纹01区间震荡，谨慎暂避			
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。