

2019年11月8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:
2019/11/07	IF	3991.9	IF1911	3990.2	0.18%	-1.67	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1912	3987.2	0.18%	-4.67	贴水缩窄	
2019/11/07	IC	5007.1	IC1911	4990.4	0.71%	-16.67	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1912	4937.2	0.59%	-69.87	贴水扩大	
2019/11/07	IH	3033.3	IH1911	3032.6	0.09%	-0.70	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1912	3030.8	0.05%	-2.50	贴水缩窄	
2019/11/07	TS	2.7629	TS1912	100.215	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.07	0.00%	-	-	
2019/11/07	TF	3.0708	TF1912	99.585	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.3	-0.01%	-	-	
2019/11/07	T	3.2736	T1912	97.81	-0.05%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	97.455	-0.02%	-	-	
2019/11/06	铁矿	714.01	I2001	611	-1.69%	-103.01	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	560	-1.23%	-154.01	贴水缩窄	
2019/11/07	螺纹	3907	RB2001	3418	-0.67%	-489.22	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3237	-0.46%	-670.22	贴水扩大	
2019/11/07	LLDPE	7250	L2001	7255	0.28%	5.00	升水扩大	完税自提价(低端价): 线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级): 上海
			L2005	7165	0.07%	-85.00	贴水缩窄	
2019/11/07	PP	8600	PP2001	7988	-0.25%	-612.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7620	-0.14%	-980.00	贴水扩大	
2019/11/07	棕榈油	5350	P2001	5312	-1.30%	-38.00	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	5500	-0.90%	150.00	升水缩窄	
2019/11/07	焦煤	1710	JM2001	1239	0.41%	-471.00	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	1149	0.66%	-561.00	贴水缩窄	
2019/11/07	焦炭	2043	J2001	1748.5	-0.03%	-294.51	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	1683	-0.09%	-360.01	贴水扩大	
2019/11/07	动力煤	552	ZC001	544.2	0.11%	-7.80	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	538	0.04%	-14.00	贴水缩窄	
2019/11/07	PTA	4775	TA001	4754	-0.79%	-21.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4816	-0.54%	41.00	升水缩窄	
2019/11/07	MA	1985	MA001	2049	-1.25%	64.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2133	-0.88%	148.00	升水扩大	
2019/11/07	橡胶	11500	RU2001	12105	-0.04%	605.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	12265	-0.08%	765.00	升水扩大	
2019/11/07	豆油	6530	Y2001	6342	-0.13%	-188.00	贴水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6240	-0.57%	-290.00	贴水扩大	
2019/11/07	豆粕	3140	M2001	2935	0.48%	-205.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M2005	2935	0.48%	-205.00	贴水缩窄	
2019/11/07	菜油	7690	OI001	7425	-0.26%	-265.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7304	0.23%	-386.00	贴水缩窄	
2019/11/07	菜粕	2354	RM001	2240	0.27%	-114.44	贴水缩窄	现货价: 均价: 菜粕
			RM005	2305	0.09%	-49.44	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 投资咨询部 2019/11/8		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）		9709.3900	9708.1300
沪股通净流入（亿元）		5.2728	9.2198	-3.9470
深股通净流入（亿元）		15.8232	-1.3091	17.1323
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.9602	1.8322	0.1280
	银行间质押式回购（7天）	2.5245	2.4829	0.0416
	Shibor（1天）	1.9150	1.7880	0.1270
	Shibor（7天）	2.5950	2.5460	0.0490
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.1350	2.0000	0.1350
	深市质押式回购	2.2550	1.8010	0.4540
期指操作建议	今日公布10月贸易帐，或公布10月新增信贷数据，MSCI扩容预计带来增量资金超2500亿，北向资金持续净流入，期指前多续持。			
能源操作建议	京津冀环保限产压力缓解，港口库存重新回升，内地需求分流港口库存有限，MA仍维持偏弱运行。			
黑色操作建议	本周钢材社库885.86万吨，环比减51.18万吨，螺纹总库存343.1万吨。钢厂利润回升，铁矿偏空情况下，成材价格恐上涨乏力，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。