

2019年11月27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:
2019/11/26	IF	3891.7	IF1912	3875.8	0.06%	-15.85	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF2001	3874.2	0.05%	-17.45	贴水扩大	
2019/11/26	IC	4882.2	IC1912	4853.2	-0.43%	-28.96	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC2001	4813	-0.45%	-69.16	贴水扩大	
2019/11/26	IH	2946.6	IH1912	2943	-0.14%	-3.57	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH2001	2941.2	-0.15%	-5.37	贴水缩窄	
2019/11/26	TS	2.6944	TS1912	100.45	0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.285	0.02%	-	-	
2019/11/26	TF	2.9801	TF1912	100.005	0.07%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.685	0.08%	-	-	
2019/11/26	T	3.1675	T1912	98.415	0.13%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	98.065	0.15%	-	-	
2019/11/25	铁矿	723.33	I2001	654.5	-1.65%	-68.83	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	606	-0.98%	-117.33	贴水缩窄	
2019/11/26	螺纹	4289	RB2001	3611	-2.33%	-677.66	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3354	-1.84%	-934.66	贴水扩大	
2019/11/26	LLDPE	7300	L2001	7210	-0.21%	-90.00	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	7155	-0.21%	-145.00	贴水扩大	
2019/11/26	PP	8400	PP2001	7993	-0.51%	-407.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7566	-0.37%	-834.00	贴水扩大	
2019/11/26	棕榈油	5470	P2001	5462	-4.28%	-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	5690	-3.33%	220.00	升水扩大	
2019/11/26	焦煤	1610	JM2001	1230.5	-2.26%	-379.50	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	1159	-2.19%	-451.00	贴水扩大	
2019/11/26	焦炭	2043	J2001	1859	-2.34%	-184.01	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	1779	-2.36%	-264.01	贴水扩大	
2019/11/26	动力煤	552	ZC001	551.8	-0.68%	-0.20	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	541.4	-0.66%	-10.60	贴水扩大	
2019/11/26	PTA	4820	TA001	4758	-1.04%	-62.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4788	-0.50%	-32.00	升水扩大	
2019/11/26	MA	1945	MA001	1977	-1.49%	32.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2076	-0.48%	131.00	升水扩大	
2019/11/26	橡胶	10700	RU2001	12585	-1.68%	1885.00	贴水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	12715	-1.28%	2015.00	升水缩窄	
2019/11/26	豆油	6310	Y2001	6232	-1.70%	-78.00	贴水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6254	-1.85%	-56.00	贴水缩窄	
2019/11/26	豆粕	3130	M2001	2880	0.07%	-250.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M2005	2761	0.18%	-369.00	贴水缩窄	
2019/11/26	菜油	7830	OI001	7520	-0.42%	-310.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7336	-0.46%	-494.00	贴水缩窄	
2019/11/26	菜粕	2294	RM001	2220	0.27%	-74.44	贴水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2279	0.31%	-15.44	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		2019/11/27		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）	9685.6500	9686.7600	-1.1100	
	沪股通净流入（亿元）	108.7528	36.5338	72.2190	
	深股通净流入（亿元）	105.5487	19.8302	85.7185	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.3686	2.2852	0.0834	
	银行间质押式回购（7天）	2.8070	2.8171	-0.0101	
	Shibor（1天）	2.3230	2.2340	0.0890	
	Shibor（7天）	2.5980	2.5960	0.0020	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7350	2.7950	-0.0600	
	深市质押式回购	2.1000	2.0200	0.0800	
期指操作建议	今日公布10月工业企业利润，北向资金净流入214.29亿元，创单日历史新高，期指IC12多单续持。				
化工品操作建议	11月中旬云南产区步入停割叠加12月下游需求阶段性好转，价格仍有支撑，沪胶轻仓逢低做多。				
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。