



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年11月29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:
2019/11/28	IF	3862.3	IF1912	3868.6	-0.26%	6.30	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF2001	3865.6	-0.26%	3.30	升水扩大	
2019/11/28	IC	4889.3	IC1912	4875.8	-0.09%	-13.46	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC2001	4837	-0.04%	-52.26	贴水缩窄	
2019/11/28	IH	2930.5	IH1912	2931.4	-0.40%	0.92	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH2001	2930.2	-0.34%	-0.28	贴水缩窄	
2019/11/28	TS	2.6868	TS1912	100.44	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.275	0.00%	-	-	
2019/11/28	TF	2.9827	TF1912	100.06	0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.65	-0.02%	-	-	
2019/11/28	T	3.165	T1912	98.395	0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	98.015	0.01%	-	-	
2019/11/27	铁矿	714.08	I2001	649.5	1.25%	-64.58	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	599.5	1.01%	-114.58	贴水扩大	
2019/11/28	螺纹	4206	RB2001	3618	0.61%	-588.19	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3418	1.73%	-788.19	贴水缩窄	
2019/11/28	LLDPE	7300	L2001	7220	0.42%	-80.00	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	7170	0.14%	-130.00	贴水缩窄	
2019/11/28	PP	8400	PP2001	8019	0.04%	-381.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7523	-0.25%	-877.00	贴水扩大	
2019/11/28	棕榈油	5420	P2001	5400	-0.74%	-20.00	贴水缩窄	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	5624	-0.81%	204.00	升水扩大	
2019/11/28	焦煤	1610	JM2001	1224.5	-0.49%	-385.50	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	1144	-1.29%	-466.00	贴水扩大	
2019/11/28	焦炭	2094	J2001	1860	-0.24%	-234.09	贴水扩大	天津港: 库平价(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	1791.5	0.36%	-302.59	贴水缩窄	
2019/11/28	动力煤	552	ZC001	546.2	0.04%	-5.80	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	533.6	-0.19%	-18.40	贴水扩大	
2019/11/28	PTA	4745	TA001	4726	-0.42%	-19.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4776	-0.33%	31.00	升水扩大	
2019/11/28	MA	1915	MA001	1947	-1.27%	32.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2062	-0.53%	147.00	升水扩大	
2019/11/28	橡胶	11750	RU2001	12475	-0.24%	725.00	贴水缩窄	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	12665	0.12%	915.00	升水扩大	
2019/11/28	豆油	6350	Y2001	6228	0.26%	-122.00	贴水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6214	-0.13%	-136.00	贴水扩大	
2019/11/28	豆粕	3130	M2001	2860	0.00%	-270.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M2005	2754	0.22%	-376.00	贴水缩窄	
2019/11/28	菜油	7870	OI001	7584	0.21%	-286.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7409	0.58%	-461.00	贴水缩窄	
2019/11/28	菜粕	2290	RM001	2207	0.46%	-83.00	贴水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2274	0.44%	-16.00	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		2019/11/29		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）	9673.0600	9655.1800	17.8800	
	沪股通净流入（亿元）	7.6002	5.8052	1.7950	
	深股通净流入（亿元）	9.7799	18.4115	-8.6316	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.1232	2.2742	-0.1510	
	银行间质押式回购（7天）	2.7598	2.7713	-0.0115	
	Shibor（1天）	2.0780	2.2330	-0.1550	
	Shibor（7天）	2.5970	2.5890	0.0080	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8550	2.6550	0.2000	
	深市质押式回购	3.0500	2.3500	0.7000	
化工品操作建议	下游需求一般，沪胶继续回调，等待逢低买入机会。				
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。