

2019年12月2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							注:
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		
2019/11/29	IF	3828.7	IF1912	3827.4	-1.06%	-1.27	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数	
			IF2001	3824	-1.08%	-4.67	贴水扩大		
2019/11/29	IC	4894.9	IC1912	4881	0.11%	-13.94	贴水扩大	现货价格: 中证500指数	
			IC2001	4843.2	0.13%	-51.74	贴水缩窄		
2019/11/29	IH	2894.7	IH1912	2893.6	-1.29%	-1.12	贴水扩大	现货价格: 上证50指数	
			IH2001	2889.4	-1.39%	-5.32	贴水扩大		
2019/11/29	TS	2.6818	TS1912	100.45	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)	
			TS2003	100.285	0.01%	-	-		
2019/11/29	TF	2.9755	TF1912	100.07	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)	
			TF2003	99.675	0.03%	-	-		
2019/11/29	T	3.165	T1912	98.4	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)	
			T2003	98.015	0.00%	-	-		
2019/11/29	铁矿	717.29	I2001	646	-0.54%	-71.29	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价	
			I2005	596	-0.58%	-121.29	贴水扩大		
2019/11/29	螺纹	4206	RB2001	3620	0.06%	-586.19	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格	
			RB2005	3427	0.26%	-779.19	贴水缩窄		
2019/11/29	LLDPE	7350	L2001	7305	1.18%	-45.00	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	7250	1.12%	-100.00	贴水缩窄		
2019/11/29	PP	8400	PP2001	8072	0.66%	-328.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚	
			PP2005	7585	0.82%	-815.00	贴水缩窄		
2019/11/29	棕榈油	5620	P2001	5594	3.59%	-26.00	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	5766	2.52%	146.00	升水缩窄		
2019/11/29	焦煤	1610	JM2001	1227	0.20%	-383.00	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	1158.5	1.27%	-451.50	贴水缩窄		
2019/11/29	焦炭	2094	J2001	1849.5	-0.56%	-244.59	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	1783.5	-0.45%	-310.59	贴水扩大		
2019/11/29	动力煤	552	ZC001	553.8	1.39%	1.80	升水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛	
			ZC005	540.8	1.35%	-11.20	贴水缩窄		
2019/11/29	PTA	4775	TA001	4772	0.97%	-3.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘	
			TA005	4818	0.88%	43.00	升水扩大		
2019/11/29	MA	1930	MA001	1951	0.21%	21.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐	
			MA005	2058	-0.19%	128.00	升水缩窄		
2019/11/29	橡胶	11650	RU2001	12380	-0.76%	730.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海	
			RU2005	12575	-0.71%	925.00	升水扩大		
2019/11/29	豆油	6350	Y2001	6280	0.83%	-70.00	贴水缩窄	现货价:四级豆油:大连	
			Y2005	6294	1.29%	-56.00	贴水缩窄		
2019/11/29	豆粕	3130	M2001	2842	-0.63%	-288.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连	
			M2005	2842	-0.63%	-288.00	贴水缩窄		
2019/11/29	菜油	7930	OI001	7671	1.15%	-259.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽	
			OI005	7489	1.08%	-441.00	贴水缩窄		
2019/11/29	菜粕	2288	RM001	2195	-0.54%	-92.78	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕	
			RM005	2273	-0.04%	-14.78	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 2019/12/2		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）	9660.0900	9673.0600	-12.9700
	沪股通净流入（亿元）	-2.9655	7.6002	-10.5657
	深股通净流入（亿元）	9.6755	9.7799	-0.1044
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.4381	2.1232	0.3149
	银行间质押式回购（7天）	2.6895	2.7598	-0.0703
	Shibor（1天）	2.3560	2.0780	0.2780
	Shibor（7天）	2.6070	2.5970	0.0100
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8050	2.8550	-0.0500
	深市质押式回购	1.1000	3.0500	-1.9500
期指操作建议	11月PMI回暖，券商政策性利好，期指或多单谨持。			
化工操作建议	MA港口库存再次去化，但市场担忧后续到港量偏多，关注西北MTO投产进度。12月预计继续累库，沪胶短期上行乏力。			
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。