今日导读

量化研发部

石丹丹 ☎:010-63197087

- **股指：**周一期指主力合约 IF1611 报收 3317.4 点，跌 0.24%。前 20 名结算会员净空头持仓 111 手，较前一交易日增加 66 手。
- **农产品：**芝加哥期货交易所(CBOT)大豆期货周一收盘小幅上涨，11 月大豆期货收高 1 美分，报蒲式耳 10.02-1/4 美元。交投最活跃的的 1 月大豆期货收跌 1/4 美分，结算价报蒲式耳 10.11-3/4 美元。豆粕和豆油期货也走低。12 月豆粕收跌 1.4 美元，报每短吨 316.10 美元，12 月豆油合约收跌 0.24 美分，报 35.17 美分。今日 CBOT 大豆预估成交量为 174,961 手，豆粕为 107,432 手，豆油为 85,942 手。美国农业部在收盘后公布的每周作物生长报告中称，截至 10 月 30 日当周，大豆收割率为 87%，之前一周为 76%，去年同期为 91%，五年均值为 85%。
- **金属：**伦敦时间 10 月 31 日 17:00(北京时间 11 月 1 日 01:00)，三个月期锌收盘没有成交，但最后报每吨 2,457.50 美元，上涨 2.5%。其在稍早触及 2011 年 8 月以来最高的 2,479.50 美元。 LME 三个月期铝收高 1%，至每吨 1,735 美元，其在稍早曾触及去年 7 月以来最高的 1,737 美元。LME 三个月期铜收高 0.2%，报每吨 4,852 美元，其在稍早曾触及三周高点 4,878 美元。其他基本金属方面，LME 三个月期铅几无变动，报每吨 2,065 美元。三个月期锡收高 0.2%，报每吨 20,700 美元。期锡稍早曾触及 2014 年 9 月以来最高的 20,745 美元，因担心供应短缺及 LME 库存低迷。三个月期镍收高 0.5%，报每吨 10,480 美元。
- **化工品：**纽约时间 10 月 31 日 13:30(北京时间 11 月 1 日 2:30)，NYMEX 12 月原油期货收跌 1.84 美元或 3.8%，报每桶 46.86 美元，为 9 月 27 日以来最低收盘价，日低为 46.71 美元。当日原油跌幅为 9 月 23 日以来最大。ICE 近月布兰特原油期货收跌 1.41 美元或 2.8%，至每桶 48.30 美元，日低为 47.98 美元。该合约周一到期。交投更活跃的次月合约急跌 2.03 美元或 4%，收报每桶 48.65 美元。RBOB 汽油期货收跌 1.3%，至每加仑 1.4495 美元。取暖油期货收低 3%，报每加仑 1.4955 美元。

© 第一创业期货量化研发部
地址：北京市西城区新街口北大街 3 号星街坊购物中心六层
邮编：100035

免责声明：

本报告是为特定客户和其他专业人士提供的参考资料。

本报告的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。

我们已力求报告内容的客观、公正，但文中的观点、结论和建议仅供参考，报告中的信息或意见并不构成所述期货交易依据，投资者据此做出的任何投资决策与本公司和作者无关。本公司不会承担因使用本报告而产生的法律责任。

本报告未经授权不得复印、转发或向特定读者群以外的人士传阅，如需引用或转载本报告，务必与第一创业期货有限责任公司联系，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改，否则后果自负。

第一创业期货有限责任公司

地　址：北京市西城区新街口北大街3号星街坊购物中心六层

电　话：010-63197003/7007/7058

邮　编：100035

网　址：http://www.fcfco.cn