今日导读

量化研发部

石丹丹 ☎:010-63197087

- **股指：**周五期指主力合约 IF1611 报收 3338.6 点，跌 0.51%。前 20 名结算会员净空头持仓 20 手，较前一交易日增加 108 手。
- **农产品：**芝加哥期货交易所(CBOT)大豆期货周五连续第二天上涨，因投资者在下周二美国大选和周三发布月度供需报告前调整头寸。指标 1 月大豆合约收高 1-1/4 美分，报每蒲式耳 9.90-3/4 美元。豆油下跌 1%，跟随马来西亚棕榈油下跌的走势，豆粕上涨约 0.8%。CBOT 12 月豆粕收高 2.6 美元，报每短吨 309 美元，12 月豆油合约收低 0.39 美分，报 34.71 美分。今日 CBOT 大豆预估成交量为 107,015 手，豆粕为 51,101 手，豆油为 120,866 手。
- **金属：**伦敦时间 11 月 4 日 17:00(北京时间 11 月 5 日 01:00)，三个月期锌收跌 1.6%，报每吨 2,447 美元，脱离之前触及的 2,491.50 美元高点。锌价周四曾触及 2,494 美元，为 2011 年 9 月以来最高。LME 锌库存周五降至 449,350 吨， LME 三个月期铜周五收涨 0.7%，报每吨 4,991 美元，盘中触及 5,003 美元高位，为 7 月 13 日来最高，一交商表示，止损买单被触发，并出现少量回补空头。三个月期铝收低 0.5%，报每吨 1,722 美元。三个月期铅上涨 0.4%，报每吨 2,100 美元。三个月期镍下滑 0.2%，收报每吨 10,460 美元。三个月期锡攀升 0.9%，收报每吨 21,300 美元，盘中触及 2014 年 9 月 5 日来最高 21,535 美元。
- **化工品：**纽约时间 11 月 4 日 13:30(北京时间 11 月 5 日 2:30)，NYMEX12 月原油期货收跌 59 美分或 1.3%，报每桶 44.07 美元。ICE 布兰特原油期货下跌 77 美分或 1.7%，至每桶 45.58 美元。二者本周各下跌约 5 美元或 9%，创下 1 月以来最大周度百分比跌幅。油价已经连续六个交易日下滑，美国原油创 7 月以来最长跌势，布兰特原油创 6 月以来最长跌势，且过去 10 天中有 9 天下跌。RBOB 汽油期货下跌 4.59 美分或 3.2%，报收于每加仑 1.3786 美元，为过去 10 日中第 8 日下跌，且为 9 月 23 日以来最低结算价。本周累计下跌 7.63 美分或 5.2%，为连续第二周下滑。取暖油期货下跌 2.79 美分或 1.9%，报收于每加仑 1.4303 美元，为过去 9 个交易日中第 7 日下跌，且结算价为 9 月 27 日以来最低。本周累计跌幅为 12.73 美分或 8.2%，为 2015 年 12 月以来最大周度跌幅。

© 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