



2019年7月4日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货 投资咨询部		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		
2019/07/03	IF	3893.5	IF1907	3879.2	-0.86%	-14.33	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数	
			IF1908	3873	-0.83%	-20.53	贴水缩窄		
2019/07/03	IC	5040.7	IC1907	5004.6	-0.57%	-36.12	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数	
			IC1908	4951	-0.64%	-89.72	贴水缩窄		
2019/07/03	IH	2964.7	IH1907	2953	-0.93%	-11.73	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数	
			IH1908	2950.6	-0.83%	-14.13	贴水缩窄		
2019/07/03	TS	2.8059	TS1909	100.215	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)	
			TS1912	100.02	0.02%	-	-		
2019/07/03	TF	2.9976	TF1909	99.73	0.05%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)	
			TF1912	99.49	0.07%	-	-		
2019/07/03	T	3.1554	T1909	98.23	0.17%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)	
			T1912	97.86	0.19%	-	-		
2019/07/02	铁矿	953.77	I1909	908.5	0.94%	-45.27	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价	
			I2001	807	2.22%	-146.77	贴水扩大		
2019/07/03	螺纹	4113	RB1910	4030	-0.57%	-83.40	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格	
			RB2001	3755	-0.56%	-358.40	贴水缩窄		
2019/07/03	LLDPE	7950	L1909	8035	-0.37%	85.00	升水缩窄	完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海	
			L2001	7875	-0.13%	-75.00	贴水扩大		
2019/07/03	PP	8800	PP1909	8853	0.41%	53.00	升水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚	
			PP2001	8329	-0.22%	-471.00	贴水扩大		
2019/07/03	棕榈油	4190	P1909	4230	-0.75%	40.00	升水缩窄	交货价: 棕榈油:天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价	
			P2001	4470	-0.40%	280.00	升水扩大		
2019/07/03	焦煤	1710	JM1909	1374	-1.86%	-336.00	贴水扩大	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产	
			JM2001	1351	-1.39%	-359.00	贴水扩大		
2019/07/03	焦炭	2298	J1909	2102	-0.40%	-196.39	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	
			J2001	2133.5	0.23%	-164.89	贴水缩窄		
2019/07/03	动力煤	612	ZC909	589	-1.80%	-23.00	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛	
			ZC001	582.4	-1.22%	-29.60	贴水扩大		
2019/07/03	PTA	6835	TA909	6318	-2.02%	-517.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘	
			TA001	5508	-1.50%	-1327.00	升水缩窄		
2019/07/03	MA	2275	MA909	2334	-0.51%	59.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐	
			MA001	2406	-0.62%	131.00	贴水扩大		
2019/07/03	橡胶	11000	RU1910	11225	-1.45%	225.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海	
			RU2001	11995	-1.48%	995.00	升水缩窄		
2019/07/03	豆油	5090	Y1909	5410	-0.37%	320.00	贴水扩大	现货价:四级豆油:大连	
			Y2001	5572	-0.36%	482.00	贴水扩大		
2019/07/03	豆粕	2880	M1909	2818	-0.14%	-62.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连	
			M1909	2818	-0.14%	-62.00	贴水缩窄		
2019/07/03	菜油	7100	O1909	6852	0.23%	-248.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽	
			O1001	6856	0.19%	-244.00	贴水缩窄		
2019/07/03	菜粕	2494	RM909	2468	-0.36%	-26.44	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕	
			RM001	2266	-0.70%	-228.44	贴水扩大		

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 2019/7/4		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）	9178.0000	9162.8000	15.2000
沪股通净流入（亿元）	0.1490	-5.0637	5.2127	
深股通净流入（亿元）	-5.0443	16.2818	-21.3261	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	0.9551	0.9842	-0.0291
	银行间质押式回购（7天）	2.1729	2.1339	0.0390
	Shibor（1天）	0.8770	0.9140	-0.0370
	Shibor（7天）	2.1450	2.0320	0.1130
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.0700	2.4400	-0.3700
	深市质押式回购	1.7010	1.7000	0.0010
期指操作建议	昨日两市缩量成交，北向资金净流出，股指震荡上行趋势不变，期指多单续持。			
期债操作建议	现券收益率持续下行，期债T09前多谨持。			
化工品操作建议	国内外产区原料逐渐释放，供需矛盾存在激化可能，09沪胶空单继续持有。标品供应相对不足，PP走势或持续强于L。			
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。