东兴期货 DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019 年 7 月 9 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：
2019/07/08	IF	3802.8	IF1907	3780	-2.44%	-22.79	贴水扩大	现货价格：沪深300指数
			IF1908	3770.4	-2.51%	-32.39	贴水扩大	
2019/07/08	IC	4870.8	IC1907	4821.6	-3.89%	-49.18	贴水扩大	现货价格：中证500指数
			IC1908	4768	-4.05%	-102.78	贴水扩大	
2019/07/08	IH	2897.5	IH1907	2884.2	-2.25%	-13.31	贴水扩大	现货价格：上证50指数
			IH1908	2883	-2.17%	-14.51	贴水缩窄	
2019/07/08	TS	2.8321	TS1909	100.155	-0.04%	-	-	现货：中债到期收益率（2年）
			TS1912	99.98	-0.03%	-	-	
2019/07/08	TF	3.0284	TF1909	99.565	-0.07%	-	-	现货：中债到期收益率（5年）
			TF1912	99.305	-0.06%	-	-	
2019/07/08	T	3.1805	T1909	97.97	-0.07%	-	-	现货：中债到期收益率（10年）
			T1912	97.59	-0.09%	-	-	
2019/07/05	铁矿	923.78	I1909	861	3.80%	-62.78	贴水扩大	现货价格：进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	759	2.92%	-164.78	贴水扩大	
2019/07/08	螺纹	4103	RB1910	3992	0.20%	-111.09	贴水缩窄	现货价格:螺纹钢:HRB400 20mm:上海，扣除理计价格
			RB2001	3737	-0.11%	-366.09	贴水缩窄	
2019/07/08	LLDPE	8130	L1909	8110	0.37%	-20.00	贴水扩大	完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海
			L2001	7940	0.51%	-190.00	贴水扩大	
2019/07/08	PP	8900	PP1909	8872	1.11%	-28.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	8370	1.00%	-530.00	贴水扩大	
2019/07/08	棕榈油	4210	P1909	4238	-0.14%	28.00	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	4456	0.09%	246.00	升水缩窄	
2019/07/08	焦煤	1710	JM1909	1374	0.44%	-336.00	贴水缩窄	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM2001	1353.5	0.19%	-356.50	贴水缩窄	
2019/07/08	焦炭	2196	J1909	2122.5	-0.82%	-73.74	贴水缩窄	天津港:平仓价(含税):一级冶金焦
			J2001	2169.5	-0.78%	-26.74	贴水缩窄	(A<12.5%,<0.65%S,CSR>65%,Mt8%):山西产，水分折算后
2019/07/08	动力煤	612	ZC909	586.4	-0.58%	-25.60	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	583	-0.55%	-29.00	贴水扩大	
2019/07/08	PTA	6475	TA909	5940	0.85%	-535.00	升水扩大	PTA：CCFEI价格指数：精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5342	0.53%	-1133.00	升水扩大	
2019/07/08	MA	2270	MA909	2323	0.04%	53.00	升水缩窄	MA：市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2417	0.17%	147.00	升水缩窄	
2019/07/08	橡胶	11000	RU1910	11085	-2.29%	85.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11790	-2.76%	790.00	升水缩窄	
2019/07/08	豆油	5150	Y1909	5456	0.48%	306.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5626	0.43%	476.00	升水缩窄	
2019/07/08	豆粕	2850	M1909	2772	-1.14%	-78.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2772	-1.14%	-78.00	贴水缩窄	
2019/07/08	菜油	7100	OI909	6887	0.15%	-213.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			OI001	6897	0.28%	-203.00	贴水缩窄	
2019/07/08	菜粕	2467	RM909	2443	-0.45%	-24.22	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2255	-0.27%	-212.22	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 2019/7/9		宏观基本面指标变化		
		隔夜	前一日	变化幅度
资金变动	两市融资余额（亿元）	9184.8000	9207.3000	-22.5000
	沪股通净流入（亿元）	-26.1495	-1.2408	-24.9087
	深股通净流入（亿元）	-9.9095	5.5179	-15.4274
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.5097	1.1315	0.3782
	银行间质押式回购（7天）	2.4144	2.1080	0.3064
	Shibor（1天）	1.4450	1.0550	0.3900
	Shibor（7天）	2.4490	2.2710	0.1780
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.0600	1.8800	0.1800
	深市质押式回购	2.0680	1.7500	0.3180
期指操作建议	今日公布6月新增信贷数据，美国非农数据超预期，降息预期下降，三大股指显著下行，北向资金净流出36亿元，谨慎者期指多单暂避。			
化工操作建议	下游对高价货的承受能力较差，TA09压力增大。			
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。