



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年7月16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:
2019/07/15	IF	3824.2	IF1907	3817.8	0.47%	-6.39	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1908	3802	0.31%	-22.19	贴水扩大	
2019/07/15	IC	4925.3	IC1907	4906	1.30%	-19.32	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1908	4848.4	1.26%	-76.92	贴水扩大	
2019/07/15	IH	2902.6	IH1907	2900.6	0.01%	-2.01	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1908	2897.2	-0.01%	-5.41	贴水扩大	
2019/07/15	TS	2.7817	TS1909	100.175	-0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	99.995	-0.02%	-	-	
2019/07/15	TF	3.0308	TF1909	99.615	-0.12%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.37	-0.10%	-	-	
2019/07/15	T	3.1782	T1909	97.99	-0.31%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	97.61	-0.27%	-	-	
2019/07/12	铁矿	940.35	I1909	895	2.52%	-45.35	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	783	2.76%	-157.35	贴水扩大	
2019/07/15	螺纹	4093	RB1910	4030	1.64%	-62.78	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3782	1.56%	-310.78	贴水缩窄	
2019/07/15	LLDPE	7850	L1909	7850	1.09%	0.00	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	7655	0.92%	-195.00	贴水缩窄	
2019/07/15	PP	8750	PP1909	8846	2.22%	96.00	升水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2001	8253	1.69%	-497.00	贴水缩窄	
2019/07/15	棕榈油	4190	P1909	4236	1.34%	46.00	升水扩大	交货价: 棕榈油: 天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P2001	4446	1.00%	256.00	升水扩大	
2019/07/15	焦煤	1710	JM1909	1398	0.11%	-312.00	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	1377	0.22%	-333.00	贴水缩窄	
2019/07/15	焦炭	2196	J1909	2167.5	2.31%	-28.74	贴水缩窄	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	2192.5	1.86%	-3.74	贴水缩窄	
2019/07/15	动力煤	601	ZC909	581	-0.17%	-20.00	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC001	581.2	0.03%	-19.80	贴水缩窄	
2019/07/15	PTA	6360	TA909	5918	-0.74%	-442.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5318	-0.19%	-1042.00	升水缩窄	
2019/07/15	MA	2200	MA909	2229	-0.22%	29.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA001	2345	-0.34%	145.00	升水缩窄	
2019/07/15	橡胶	10450	RU1910	10705	-0.19%	255.00	升水缩窄	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	11535	0.65%	1085.00	升水缩窄	
2019/07/15	豆油	5200	Y1909	5468	1.26%	268.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2001	5632	1.08%	432.00	升水扩大	
2019/07/15	豆粕	2860	M1909	2861	1.89%	1.00	升水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M1909	2861	1.89%	1.00	升水扩大	
2019/07/15	菜油	7150	O1909	6944	1.89%	-206.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			O1001	6971	1.93%	-179.00	贴水缩窄	
2019/07/15	菜粕	2468	RM909	2487	2.26%	19.22	升水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM001	2306	1.68%	-161.78	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		2019/7/16	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）	9116.4000	9139.6000	-23.2000	
	沪股通净流入（亿元）	-21.2942	7.7521	-29.0463	
	深股通净流入（亿元）	6.8842	6.8406	0.0436	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6799	2.2857	0.3942	
	银行间质押式回购（7天）	2.7579	2.4486	0.3093	
	Shibor（1天）	2.6175	2.2350	0.3825	
	Shibor（7天）	2.6690	2.5590	0.1100	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8700	2.7600	0.1100	
	深市质押式回购	2.6900	2.5500	0.1400	
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，北向资金净流出，短期指数弱势震荡或延续，期指多单暂避。				
化工操作建议	沪胶继续下探，09沪胶空单继续 持有，关注10000支撑。				
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。