



2019年7月17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:
2019/07/16	IF	3806.8	IF1907	3803.4	-0.38%	-3.44	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1908	3793	-0.24%	-13.84	贴水缩窄	
2019/07/16	IC	4932	IC1907	4921.2	0.31%	-10.85	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1908	4866	0.36%	-66.05	贴水缩窄	
2019/07/16	IH	2884.6	IH1907	2884.2	-0.57%	-0.36	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1908	2881.4	-0.55%	-3.16	贴水缩窄	
2019/07/16	TS	2.7822	TS1909	100.175	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	99.995	0.00%	-	-	
2019/07/16	TF	3.0311	TF1909	99.63	0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.375	0.01%	-	-	
2019/07/16	T	3.1732	T1909	98.035	0.05%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	97.675	0.07%	-	-	
2019/07/15	铁矿	951.2	I1909	905	1.12%	-46.20	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
2019/07/16	螺纹	4124	I2001	800.5	2.23%	-150.70	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB1910	4037	0.17%	-86.71	贴水扩大	
2019/07/16	LLDPE	7800	RB2001	3785	0.08%	-338.71	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
			L1909	7770	-1.02%	-30.00	贴水扩大	
2019/07/16	PP	8800	L2001	7565	-1.18%	-235.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP1909	8789	-0.64%	-11.00	贴水扩大	
2019/07/16	棕榈油	4190	PP2001	8242	-0.13%	-558.00	贴水扩大	交货价: 棕榈油: 天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P1909	4220	-0.38%	30.00	升水缩窄	
2019/07/16	焦煤	1710	P2001	4430	-0.36%	240.00	升水缩窄	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产
			JM1909	1420.5	1.61%	-289.50	贴水缩窄	
2019/07/16	焦炭	2196	JM2001	1397.5	1.49%	-312.50	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
			J1909	2173.5	0.28%	-22.74	贴水缩窄	
2019/07/16	动力煤	600	J2001	2199.5	0.32%	3.26	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC909	584	0.52%	-16.00	贴水缩窄	
2019/07/16	PTA	6300	ZC001	583	0.31%	-17.00	贴水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA909	5890	-0.47%	-410.00	升水扩大	
2019/07/16	MA	2155	TA001	5302	-0.30%	-998.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA909	2172	-2.56%	17.00	升水缩窄	
2019/07/16	橡胶	10300	MA001	2287	-2.47%	132.00	升水缩窄	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU1910	10615	-0.84%	315.00	升水缩窄	
2019/07/16	豆油	5200	RU2001	11395	-1.21%	1095.00	升水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y1909	5440	-0.51%	240.00	升水缩窄	
2019/07/16	豆粕	2860	Y2001	5606	-0.46%	406.00	升水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M1909	2813	-1.68%	-47.00	贴水扩大	
2019/07/16	菜油	7150	M1909	2813	-1.68%	-47.00	升水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			O1909	6927	-0.24%	-223.00	贴水扩大	
2019/07/16	菜粕	2452	O1001	6951	-0.29%	-199.00	贴水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM909	2428	-2.37%	-24.22	贴水扩大	
			RM001	2257	-2.12%	-195.22	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

 <b>东兴期货</b> 投资咨询部     2019/7/17		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）	7.0834	-21.2942	28.3776
	深股通净流入（亿元）	3.0086	6.8842	-3.8756
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.8063	2.6799	0.1264
	银行间质押式回购（7天）	2.8782	2.7579	0.1203
	Shibor（1天）	2.7250	2.6175	0.1075
	Shibor（7天）	2.7240	2.6690	0.0550
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.9100	2.8700	0.0400
	深市质押式回购	2.8990	2.6900	0.2090
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，指数延续弱势震荡，期指多单暂避。			
期债操作建议	货币政策环境支撑债市，期债高位整理，T09前多谨持。			
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。