

2019年7月23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:
2019/07/22	IF	3781.7	IF1908	3769.2	-0.79%	-12.48	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3762	-0.80%	-19.68	贴水扩大	
2019/07/22	IC	4776.6	IC1908	4733.2	-1.87%	-43.37	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4675	-1.82%	-101.57	贴水扩大	
2019/07/22	IH	2881.9	IH1909	2876	-0.63%	-5.90	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2876	-0.63%	-5.90	贴水扩大	
2019/07/22	TS	2.7843	TS1909	100.24	0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.05	0.02%	-	-	
2019/07/22	TF	2.999	TF1909	99.835	0.07%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.57	0.07%	-	-	
2019/07/22	T	3.1484	T1909	98.375	0.13%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	97.98	0.11%	-	-	
2019/07/19	铁矿	961.84	I1909	885	-3.38%	-76.84	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	757	-4.78%	-204.84	贴水缩窄	
2019/07/22	螺纹	4124	RB1910	3948	-1.32%	-175.71	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3726	-1.32%	-397.71	贴水扩大	
2019/07/22	LLDPE	7750	L1909	7720	-1.28%	-30.00	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	7550	-0.79%	-200.00	贴水扩大	
2019/07/22	PP	8750	PP1909	8614	-0.05%	-136.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	8169	0.54%	-581.00	贴水扩大	
2019/07/22	棕榈油	4180	P1909	4214	0.57%	34.00	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	4400	0.09%	220.00	升水缩窄	
2019/07/22	焦煤	1710	JM1909	1395.5	-1.59%	-314.50	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	1381	-1.53%	-329.00	贴水扩大	
2019/07/22	焦炭	2298	J1909	2141	-2.10%	-157.39	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	2177	-1.89%	-121.39	贴水扩大	
2019/07/22	动力煤	591	ZC909	586.2	0.03%	-4.80	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	585.4	0.17%	-5.60	贴水缩窄	
2019/07/22	PTA	6230	TA909	5596	-4.54%	-634.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5238	-0.64%	-992.00	升水缩窄	
2019/07/22	MA	2120	MA909	2159	-1.19%	39.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2282	-0.78%	162.00	升水扩大	
2019/07/22	橡胶	10500	RU1910	10765	-0.28%	265.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11690	0.17%	1190.00	升水扩大	
2019/07/22	豆油	5180	Y1909	5432	0.56%	252.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5584	0.40%	404.00	升水扩大	
2019/07/22	豆粕	2860	M1909	2797	-1.51%	-63.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2797	-1.51%	-63.00	贴水扩大	
2019/07/22	菜油	7150	OI909	6931	0.03%	-219.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			OI001	6967	-0.01%	-183.00	贴水扩大	
2019/07/22	菜粕	2410	RM909	2389	-1.89%	-21.00	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2267	-0.13%	-143.00	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		2019/7/23		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）	9104.3400	9127.1000	-22.7600	
	沪股通净流入（亿元）	-5.7870	42.8745	-48.6615	
	深股通净流入（亿元）	9.6370	19.0179	-9.3809	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.7359	2.9410	-0.2051	
	银行间质押式回购（7天）	2.8618	3.0559	-0.1941	
	Shibor（1天）	2.6698	2.8270	-0.1572	
	Shibor（7天）	2.6920	2.7530	-0.0610	
二级市场流动性	沪市质押式回购	3.1400	3.1850	-0.0450	
	深市质押式回购	3.0000	2.8000	0.2000	
期指操作建议	当前市场方向尚未明朗，谨慎者期指多单暂避，关注月末中央经济会议。				
化工品操作建议	国内外产区进入增产期，09沪胶低位震荡，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。