

2019年7月24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:
2019/07/23	IF	3789.9	IF1908	3780	0.29%	-9.91	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3771.8	0.26%	-18.11	贴水缩窄	
2019/07/23	IC	4823.9	IC1908	4776.4	0.91%	-47.52	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4719.6	0.95%	-104.32	贴水扩大	
2019/07/23	IH	2881.1	IH1909	2875.2	-0.03%	-5.90	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2875.2	-0.03%	-5.90	贴水缩窄	
2019/07/23	TS	2.7747	TS1909	100.24	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.055	0.00%	-	-	
2019/07/23	TF	2.9919	TF1909	99.825	-0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.545	-0.03%	-	-	
2019/07/23	T	3.1484	T1909	98.38	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	97.985	0.01%	-	-	
2019/07/23	铁矿	949.23	I1909	880	-0.56%	-69.23	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	758.5	0.20%	-190.73	贴水缩窄	
2019/07/23	螺纹	4113	RB1910	3941	-0.18%	-172.40	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3721	-0.13%	-392.40	贴水缩窄	
2019/07/23	LLDPE	7750	L1909	7745	0.32%	-5.00	贴水缩窄	完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海
			L2001	7580	0.40%	-170.00	贴水缩窄	
2019/07/23	PP	8800	PP1909	8689	0.87%	-111.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	8235	0.81%	-565.00	贴水缩窄	
2019/07/23	棕榈油	4190	P1909	4246	0.76%	56.00	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	4414	0.32%	224.00	升水扩大	
2019/07/23	焦煤	1710	JM1909	1393.5	-0.14%	-316.50	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	1381.5	0.04%	-328.50	贴水缩窄	
2019/07/23	焦炭	2298	J1909	2154	0.61%	-144.39	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	2184	0.32%	-114.39	贴水缩窄	
2019/07/23	动力煤	591	ZC909	593	1.16%	2.00	升水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	587	0.27%	-4.00	贴水缩窄	
2019/07/23	PTA	5930	TA909	5504	-1.64%	-426.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5150	-1.68%	-780.00	升水缩窄	
2019/07/23	MA	2060	MA909	2102	-2.64%	42.00	升水扩大	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2239	-1.88%	179.00	升水扩大	
2019/07/23	橡胶	10500	RU1910	10785	0.19%	285.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11640	-0.43%	1140.00	升水缩窄	
2019/07/23	豆油	5180	Y1909	5452	0.37%	272.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5594	0.18%	414.00	升水扩大	
2019/07/23	豆粕	2860	M1909	2814	0.61%	-46.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2814	0.61%	-46.00	贴水缩窄	
2019/07/23	菜油	7150	O1909	6949	0.26%	-201.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1001	6981	0.20%	-169.00	贴水缩窄	
2019/07/23	菜粕	2407	RM909	2412	0.96%	5.33	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2272	0.22%	-134.67	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 2019/7/24		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）	9080.6300	9104.3400	-23.7100
	沪股通净流入（亿元）	3.3441	-5.7870	9.1311
	深股通净流入（亿元）	-7.4007	9.6370	-17.0377
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6084	2.7359	-0.1275
	银行间质押式回购（7天）	2.7486	2.8618	-0.1132
	Shibor（1天）	2.5620	2.6698	-0.1078
	Shibor（7天）	2.6340	2.6920	-0.0580
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.9600	3.1400	-0.1800
	深市质押式回购	2.8000	3.0000	-0.2000
期指操作建议	两市缩量成交，北向资金净流出，期指多单暂避。			
农产品操作建议	6月我国食糖进口14万吨，同比较少14万吨，环比较少24万吨，低于市场预期，推动郑糖走强，关注八月初的产销数据，若数据较好可支撑郑糖短期表现。			
化工品操作建议	持续下跌之后，沪胶自身空头打压较弱，09沪胶等待新空机会。			
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。