



2019年8月2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 | | | | | | 注: |
|--------------------------------|-------|--------|--------|---------|--------|---------|-------|---|
| 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 | |
| 2019/08/01 | IF | 3803.5 | IF1908 | 3798.4 | -1.03% | -5.07 | 贴水扩大 | 现货价格: 沪深300指数 |
| | | | IF1909 | 3791.2 | -1.01% | -12.27 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | IC | 4870.5 | IC1908 | 4841 | -0.68% | -29.47 | 贴水扩大 | 现货价格: 中证500指数 |
| | | | IC1909 | 4785.2 | -0.70% | -85.27 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | IH | 2887.9 | IH1908 | 2887.2 | -0.93% | -0.67 | 贴水扩大 | 现货价格: 上证50指数 |
| | | | IH1909 | 2885 | -0.96% | -2.87 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | TS | 2.7582 | TS1909 | 100.245 | 0.00% | - | - | 现货: 中债到期收益率(2年) |
| | | | TS1912 | 100.07 | 0.00% | - | - | |
| 2019/08/01 | TF | 2.9838 | TF1909 | 99.855 | 0.01% | - | - | 现货: 中债到期收益率(5年) |
| | | | TF1912 | 99.57 | 0.02% | - | - | |
| 2019/08/01 | T | 3.1487 | T1909 | 98.445 | 0.06% | - | - | 现货: 中债到期收益率(10年) |
| | | | T1912 | 97.995 | 0.06% | - | - | |
| 2019/08/01 | 铁矿 | 946.99 | I1909 | 886 | -1.28% | -60.99 | 贴水扩大 | 现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价 |
| | | | I2001 | 747.5 | -2.03% | -199.49 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | 螺纹 | 4031 | RB1910 | 3846 | -1.16% | -184.93 | 贴水扩大 | 现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格 |
| | | | RB2001 | 3635 | -0.60% | -395.93 | 贴水缩窄 | |
| 2019/08/01 | LLDPE | 7650 | L1909 | 7710 | 0.98% | 60.00 | 升水扩大 | 完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海 |
| | | | L2001 | 7610 | 0.66% | -40.00 | 贴水缩窄 | |
| 2019/08/01 | PP | 8730 | PP1909 | 8629 | 0.41% | -101.00 | 贴水缩窄 | 市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚 |
| | | | PP2001 | 8295 | 1.15% | -435.00 | 贴水缩窄 | |
| 2019/08/01 | 棕榈油 | 4320 | P1909 | 4338 | -0.46% | 18.00 | 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 |
| | | | P2001 | 4502 | -0.71% | 182.00 | 升水缩窄 | |
| 2019/08/01 | 焦煤 | 1710 | JM1909 | 1391.5 | -0.57% | -318.50 | 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 | 1382.5 | -0.54% | -327.50 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | 焦炭 | 2298 | J1909 | 2105 | -1.70% | -193.39 | 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 | 2147.5 | -1.76% | -150.89 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | 动力煤 | 594 | ZC909 | 583.4 | -0.75% | -10.60 | 贴水扩大 | 市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛 |
| | | | ZC001 | 577.4 | -0.89% | -16.60 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | PTA | 5425 | TA909 | 5376 | -0.59% | -49.00 | 升水缩窄 | PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘 |
| | | | TA001 | 5234 | 0.27% | -191.00 | 升水扩大 | |
| 2019/08/01 | MA | 2070 | MA909 | 2113 | -0.05% | 43.00 | 升水缩窄 | MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐 |
| | | | MA001 | 2229 | -0.18% | 159.00 | 升水缩窄 | |
| 2019/08/01 | 橡胶 | 10500 | RU1910 | 10615 | -1.21% | 115.00 | 升水缩窄 | 市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海 |
| | | | RU2001 | 11455 | -1.21% | 955.00 | 升水缩窄 | |
| 2019/08/01 | 豆油 | 5330 | Y1909 | 5518 | -0.65% | 188.00 | 升水缩窄 | 现货价:四级豆油:大连 |
| | | | Y2001 | 5682 | -0.46% | 352.00 | 升水缩窄 | |
| 2019/08/01 | 豆粕 | 2860 | M1909 | 2773 | -0.93% | -87.00 | 贴水扩大 | 现货价:豆粕:大连 |
| | | | M1909 | 2773 | -0.93% | -87.00 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | 菜油 | 7180 | O1909 | 6948 | 0.22% | -232.00 | 贴水缩窄 | 现货价:菜油:安徽 |
| | | | O1001 | 6990 | 0.00% | -190.00 | 贴水扩大 | |
| 2019/08/01 | 菜粕 | 2403 | RM909 | 2381 | -1.12% | -22.33 | 贴水扩大 | 现货价:平均价:菜粕 |
| | | | RM001 | 2220 | -1.03% | -183.33 | 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

|  东兴期货 投资咨询部 2019/8/2 | | 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） | 9085.9000 | 9090.2500 | -4.3500 |
| 沪股通净流入（亿元） | -12.8255 | -6.2130 | -6.6125 | |
| 深股通净流入（亿元） | 1.3173 | 1.2214 | 0.0959 | |
| 宏观流动性 | 银行间质押式回购（1天） | 2.6941 | 2.7464 | -0.0523 |
| | 银行间质押式回购（7天） | 2.6750 | 2.7875 | -0.1125 |
| | Shibor（1天） | 2.6340 | 2.6420 | -0.0080 |
| | Shibor（7天） | 2.6380 | 2.6730 | -0.0350 |
| 二级市场流动性 | 沪市质押式回购 | 2.6800 | 2.8400 | -0.1600 |
| | 深市质押式回购 | 2.7000 | 2.0000 | 0.7000 |
| 期指操作建议 | 特朗普加征关税言论令昨日美股大跌，避险情绪上升，短期弱势震荡，期指多单暂避。 | | | |
| 化工操作建议 | 泰国原料价格持续下行，沪胶空单继续持有。 | | | |
| 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。