



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年8月5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:
2019/08/02	IF	3747.4	IF1908	3740	-1.54%	-7.44	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3730	-1.61%	-17.44	贴水扩大	
2019/08/02	IC	4809.9	IC1908	4779.2	-1.28%	-30.72	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4724	-1.28%	-85.92	贴水扩大	
2019/08/02	IH	2843.8	IH1908	2842.8	-1.54%	-0.97	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2838.8	-1.60%	-4.97	贴水扩大	
2019/08/02	TS	2.7489	TS1909	100.325	0.08%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.15	0.08%	-	-	
2019/08/02	TF	2.9427	TF1909	100	0.15%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.705	0.14%	-	-	
2019/08/02	T	3.0914	T1909	98.72	0.28%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.285	0.30%	-	-	
2019/08/02	铁矿	930.62	I1909	866	-2.26%	-64.62	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	724.5	-3.08%	-206.12	贴水扩大	
2019/08/02	螺纹	3979	RB1910	3816	-0.78%	-163.38	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3590	-1.24%	-389.38	贴水缩窄	
2019/08/02	LLDPE	7600	L1909	7605	-1.36%	5.00	升水缩窄	完税自提价(低端价): 线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级): 上海
			L2001	7520	-1.18%	-80.00	贴水扩大	
2019/08/02	PP	8650	PP1909	8549	-0.93%	-101.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2001	8204	-1.10%	-446.00	贴水扩大	
2019/08/02	棕榈油	4360	P1909	4378	0.92%	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	4528	0.58%	168.00	升水缩窄	
2019/08/02	焦煤	1710	JM1909	1401.5	0.72%	-308.50	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	1361.5	-1.52%	-348.50	贴水扩大	
2019/08/02	焦炭	2298	J1909	2051	-2.57%	-247.39	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	2076.5	-3.31%	-221.89	贴水扩大	
2019/08/02	动力煤	594	ZC909	580.6	-0.48%	-13.40	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC001	574.4	-0.52%	-19.60	贴水扩大	
2019/08/02	PTA	5295	TA909	5252	-2.31%	-43.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5154	-1.53%	-141.00	升水缩窄	
2019/08/02	MA	2080	MA909	2130	0.80%	50.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA001	2237	0.36%	157.00	升水缩窄	
2019/08/02	橡胶	10250	RU1910	10340	-2.59%	90.00	升水缩窄	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	11195	-2.27%	945.00	升水缩窄	
2019/08/02	豆油	5330	Y1909	5558	0.72%	228.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2001	5718	0.63%	388.00	升水扩大	
2019/08/02	豆粕	2860	M1909	2819	1.66%	-41.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M1909	2819	1.66%	-41.00	贴水缩窄	
2019/08/02	菜油	7180	OI909	6957	0.13%	-223.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI001	6995	0.07%	-185.00	贴水缩窄	
2019/08/02	菜粕	2413	RM909	2414	1.39%	0.67	升水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM001	2245	1.13%	-168.33	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		2019/8/5	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）	9090.5300	9085.9000	4.6300
	沪股通净流入（亿元）	-46.5566	-12.8255	-33.7311
	深股通净流入（亿元）	-21.5633	1.3173	-22.8806
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6701	2.6941	-0.0240
	银行间质押式回购（7天）	2.6812	2.6750	0.0062
	Shibor（1天）	2.6340	2.6340	0.0000
	Shibor（7天）	2.6470	2.6380	0.0090
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8950	2.6800	0.2150
	深市质押式回购	2.6000	2.7000	-0.1000
期指操作建议	短期弱势震荡或延续，期指多单暂避。			
期债操作建议	本周无逆回购到期，期债T09前多谨持。			
化工操作建议	近月面临交割压力，期价维持弱势，09沪胶空单持有。			
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。