

2019年8月6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:
2019/08/05	IF	3675.7	IF1908	3667	-1.95%	-8.69	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3656.2	-1.98%	-19.49	贴水扩大	
2019/08/05	IC	4752	IC1908	4725	-1.13%	-26.98	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4672.4	-1.09%	-79.58	贴水缩窄	
2019/08/05	IH	2786.7	IH1908	2787	-1.96%	0.28	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2784.6	-1.91%	-2.12	贴水缩窄	
2019/08/05	TS	2.7283	TS1909	100.43	0.10%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.25	0.10%	-	-	
2019/08/05	TF	2.9102	TF1909	100.205	0.20%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.89	0.19%	-	-	
2019/08/05	T	3.0563	T1909	99.065	0.35%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.595	0.32%	-	-	
2019/08/02	铁矿	930.62	I1909	803	-7.27%	-127.62	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	689.5	-4.83%	-241.12	贴水扩大	
2019/08/05	螺纹	3938	RB1910	3753	-1.65%	-185.14	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3525	-1.81%	-413.14	贴水扩大	
2019/08/05	LLDPE	7550	L1909	7485	-1.58%	-65.00	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	7430	-1.20%	-120.00	贴水扩大	
2019/08/05	PP	8650	PP1909	8424	-1.46%	-226.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	8016	-2.29%	-634.00	贴水扩大	
2019/08/05	棕榈油	4440	P1909	4444	1.51%	4.00	升水缩窄	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	4612	1.86%	172.00	升水扩大	
2019/08/05	焦煤	1710	JM1909	1400.5	-0.07%	-309.50	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	1343.5	-1.32%	-366.50	贴水扩大	
2019/08/05	焦炭	2247	J1909	2031.5	-0.95%	-215.81	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	2030.5	-2.22%	-216.81	贴水缩窄	
2019/08/05	动力煤	592	ZC909	577	-0.62%	-15.00	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	570.4	-0.70%	-21.60	贴水扩大	
2019/08/05	PTA	5160	TA909	5158	-1.79%	-2.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5116	-0.74%	-44.00	升水扩大	
2019/08/05	MA	2020	MA909	2058	-3.38%	38.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2186	-2.28%	166.00	升水扩大	
2019/08/05	橡胶	10150	RU1910	10365	0.24%	215.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11180	-0.13%	1030.00	升水缩窄	
2019/08/05	豆油	5530	Y1909	5676	2.12%	146.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5850	2.31%	320.00	升水缩窄	
2019/08/05	豆粕	2860	M1909	2864	1.60%	4.00	升水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2864	1.60%	4.00	升水扩大	
2019/08/05	菜油	7200	O1909	7006	0.70%	-194.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1001	7061	0.94%	-139.00	贴水缩窄	
2019/08/05	菜粕	2445	RM909	2470	2.32%	25.00	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2300	2.45%	-145.00	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 2019/8/6		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）	9055.1600	9090.5300	-35.3700
	沪股通净流入（亿元）	-24.2959	-46.5566	22.2607
	深股通净流入（亿元）	-10.3344	-21.5633	11.2289
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.5835	2.6701	-0.0866
	银行间质押式回购（7天）	2.6962	2.6812	0.0150
	Shibor（1天）	2.5440	2.6340	-0.0900
	Shibor（7天）	2.6190	2.6470	-0.0280
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7650	2.8950	-0.1300
	深市质押式回购	2.5120	2.6000	-0.0880
期指操作建议	人民币汇率破7，市场避险情绪升温，白马业绩放缓，可做空IH/IC比价。			
化工操作建议	宏观悲观情绪严重叠加天胶供需矛盾仍存，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。