



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年8月7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:
2019/08/06	IF	3636.3	IF1908	3625.8	-1.12%	-10.53	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3612.6	-1.19%	-23.73	贴水扩大	
2019/08/06	IC	4650.6	IC1908	4626.8	-2.08%	-23.76	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4570	-2.19%	-80.56	贴水扩大	
2019/08/06	IH	2760.7	IH1909	2754	-1.10%	-6.68	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2754	-1.10%	-6.68	贴水扩大	
2019/08/06	TS	2.7026	TS1909	100.425	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.28	0.03%	-	-	
2019/08/06	TF	2.9199	TF1909	100.17	-0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.885	-0.01%	-	-	
2019/08/06	T	3.0613	T1909	99.065	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.63	0.04%	-	-	
2019/08/05	铁矿	898.74	I1909	780.5	-2.80%	-118.24	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石: 62%品位: 干基粉矿含税价
			I2001	693.5	0.58%	-205.24	贴水扩大	
2019/08/06	螺纹	3897	RB1910	3707	-1.23%	-189.91	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢: HRB400 20mm: 上海, 扣除理计价格
			RB2001	3497	-0.79%	-399.91	贴水缩窄	
2019/08/06	LLDPE	7500	L1909	7450	-0.47%	-50.00	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	7410	-0.27%	-90.00	贴水缩窄	
2019/08/06	PP	8650	PP1909	8497	0.87%	-153.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2001	8077	0.76%	-573.00	贴水缩窄	
2019/08/06	棕榈油	4450	P1909	4460	0.36%	10.00	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	4628	0.35%	178.00	升水扩大	
2019/08/06	焦煤	1710	JM1909	1406	0.39%	-304.00	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	1346	0.19%	-364.00	贴水缩窄	
2019/08/06	焦炭	2247	J1909	2036.5	0.25%	-210.81	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	2003	-1.35%	-244.31	贴水扩大	
2019/08/06	动力煤	590	ZC909	578	0.17%	-12.00	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC001	568.8	-0.28%	-21.20	贴水缩窄	
2019/08/06	PTA	5100	TA909	5132	-0.50%	32.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5146	0.59%	46.00	升水扩大	
2019/08/06	MA	2040	MA909	2081	1.12%	41.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA001	2205	0.87%	165.00	升水缩窄	
2019/08/06	橡胶	10250	RU1910	10615	2.41%	365.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	11555	3.35%	1305.00	升水扩大	
2019/08/06	豆油	5530	Y1909	5710	0.60%	180.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2001	5874	0.41%	344.00	升水扩大	
2019/08/06	豆粕	2950	M1909	2860	-0.14%	-90.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M1909	2860	-0.14%	-90.00	贴水扩大	
2019/08/06	菜油	7200	O1909	7013	0.10%	-187.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			O1001	7091	0.42%	-109.00	贴水缩窄	
2019/08/06	菜粕	2454	RM909	2461	-0.36%	6.56	升水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM001	2299	-0.04%	-155.44	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		2019/8/7		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）	9061.3700	9055.1600	6.2100	
	沪股通净流入（亿元）	-32.4501	-24.2959	-8.1542	
	深股通净流入（亿元）	2.6628	-10.3344	12.9972	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.3028	2.5835	-0.2807	
	银行间质押式回购（7天）	2.6395	2.6962	-0.0567	
	Shibor（1天）	2.2610	2.5440	-0.2830	
	Shibor（7天）	2.4940	2.6190	-0.1250	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.6050	2.7650	-0.1600	
	深市质押式回购	2.1000	2.5120	-0.4120	
化工品操作建议	到港高峰压制盘面价格，内地装置亏损，关注是否有额外检修计划支撑盘面，MA09空单继续持有。沪胶在大跌后反弹，不可过于乐观，09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。