东兴期货 DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019 年 8 月 12 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：
2019/08/09	IF	3633.5	IF1908	3621.6	-0.47%	-11.93	贴水缩窄	现货价格：沪深300指数
			IF1909	3605	-0.49%	-28.53	贴水缩窄	
2019/08/09	IC	4600.4	IC1908	4570.6	-1.00%	-29.75	贴水缩窄	现货价格：中证500指数
			IC1909	4512	-1.05%	-88.35	贴水缩窄	
2019/08/09	IH	2772.1	IH1909	2747.4	-0.38%	-24.75	贴水缩窄	现货价格：上证50指数
			IH1909	2747.4	-0.38%	-24.75	贴水缩窄	
2019/08/09	TS	2.6999	TS1909	100.485	0.03%	-	-	现货：中债到期收益率（2年）
			TS1912	100.325	0.03%	-	-	
2019/08/09	TF	2.9061	TF1909	100.23	0.05%	-	-	现货：中债到期收益率（5年）
			TF1912	100.025	0.09%	-	-	
2019/08/09	T	3.0216	T1909	99.27	0.15%	-	-	现货：中债到期收益率（10年）
			T1912	98.89	0.17%	-	-	
2019/08/09	铁矿	813.28	I1909	738	-2.83%	-75.28	贴水扩大	现货价格：进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	639	-3.26%	-174.28	贴水扩大	
2019/08/09	螺纹	3814	RB1910	3591	-2.21%	-223.43	贴水缩窄	现货价格:螺纹钢:HRB400 20mm:上海，扣除理计价格
			RB2001	3405	-2.07%	-409.43	贴水缩窄	
2019/08/09	LLDPE	7500	L1909	7535	0.87%	35.00	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	7560	1.48%	60.00	升水扩大	
2019/08/09	PP	8650	PP1909	8547	0.89%	-103.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	8163	1.34%	-487.00	贴水缩窄	
2019/08/09	棕榈油	4580	P1909	4612	3.13%	32.00	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	4784	2.62%	204.00	升水扩大	
2019/08/09	焦煤	1710	JM1909	1416	0.35%	-294.00	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	1318.5	-0.79%	-391.50	贴水扩大	
2019/08/09	焦炭	2247	J1909	2037.5	-1.24%	-209.81	贴水扩大	天津港:平仓价(含税):一级冶金焦
			J2001	1935.5	-3.99%	-311.81	贴水扩大	(A<12.5%,<0.65%S,CSR>65%,Mt8%):山西产，水分折算后
2019/08/09	动力煤	584	ZC909	574.4	-0.55%	-9.60	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	568	0.00%	-16.00	贴水缩窄	
2019/08/09	PTA	5170	TA909	5200	0.62%	30.00	升水扩大	PTA：CCFEI价格指数：精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5152	-0.04%	-18.00	升水扩大	
2019/08/09	MA	2090	MA909	2135	-0.37%	45.00	升水扩大	MA：市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2265	0.49%	175.00	升水扩大	
2019/08/09	橡胶	10400	RU1910	10595	-0.61%	195.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11625	0.43%	1225.00	升水扩大	
2019/08/09	豆油	5800	Y1909	6008	3.05%	208.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	6150	3.08%	350.00	升水扩大	
2019/08/09	豆粕	2980	M1909	2912	1.01%	-68.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2912	1.01%	-68.00	贴水扩大	
2019/08/09	菜油	7300	OI909	7169	1.63%	-131.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			OI001	7247	1.27%	-53.00	贴水缩窄	
2019/08/09	菜粕	2445	RM909	2491	1.18%	46.00	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2330	0.82%	-115.00	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 2019/8/12		宏观基本面指标变化		
		隔夜	前一日	变化幅度
资金变动	两市融资余额（亿元）	8965.0500	8977.3400	-12.2900
	沪股通净流入（亿元）	-0.4678	9.3620	-9.8298
	深股通净流入（亿元）	14.4168	16.1305	-1.7137
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6497	2.5530	0.0967
	银行间质押式回购（7天）	2.6470	2.5845	0.0625
	Shibor（1天）	2.5960	2.5000	0.0960
	Shibor（7天）	2.6440	2.5780	0.0660
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.6700	2.3700	0.3000
	深市质押式回购	2.7500	2.0000	0.7500
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，短期股指难有明显上行趋势，谨慎者期指多单暂避。			
化工品操作建议	20号胶合约今天上市，基准定价9260元/吨，定价偏低有走高空间。			
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。