

2019年8月13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	
2019/08/12	IF	3699.1	IF1908	3672.8	1.41%	-26.30	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3651.6	1.29%	-47.50	贴水扩大	
2019/08/12	IC	4685	IC1908	4665.8	2.08%	-19.24	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4609.8	2.17%	-75.24	贴水缩窄	
2019/08/12	IH	2824.8	IH1909	2787	1.44%	-37.80	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2787	1.44%	-37.80	贴水扩大	
2019/08/12	TS	2.7206	TS1909	100.445	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.28	-0.04%	-	-	
2019/08/12	TF	2.9205	TF1909	100.265	0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	100.03	0.00%	-	-	
2019/08/12	T	3.0391	T1909	99.215	-0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.825	-0.07%	-	-	
2019/08/09	铁矿	813.28	I1909	727.5	-1.42%	-85.78	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	638.5	-0.08%	-174.78	贴水扩大	
2019/08/12	螺纹	3773	RB1910	3677	2.39%	-96.20	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3451	1.35%	-322.20	贴水缩窄	
2019/08/12	LLDPE	7550	L1909	7555	0.27%	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	7580	0.26%	30.00	升水缩窄	
2019/08/12	PP	8700	PP1909	8532	-0.18%	-168.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP料(T30S):余姚
			PP2001	8168	0.06%	-532.00	贴水扩大	
2019/08/12	棕榈油	4700	P1909	4664	1.13%	-36.00	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	4830	0.96%	130.00	升水缩窄	
2019/08/12	焦煤	1710	JM1909	1409	-0.49%	-301.00	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	1335	1.25%	-375.00	贴水缩窄	
2019/08/12	焦炭	2247	J1909	2060	1.10%	-187.31	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	2009	3.80%	-238.31	贴水缩窄	
2019/08/12	动力煤	582	ZC909	578.4	0.70%	-3.60	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	572.2	0.74%	-9.80	贴水缩窄	
2019/08/12	PTA	5160	TA909	5218	0.35%	58.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5158	0.12%	-2.00	升水缩窄	
2019/08/12	MA	2100	MA909	2134	-0.05%	34.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2257	-0.35%	157.00	升水缩窄	
2019/08/12	橡胶	10400	RU1910	10600	0.05%	200.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11490	-1.16%	1090.00	升水缩窄	
2019/08/12	豆油	6000	Y1909	6040	0.53%	40.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	6160	0.16%	160.00	升水缩窄	
2019/08/12	豆粕	2980	M1909	2901	-0.38%	-79.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2901	-0.38%	-79.00	贴水扩大	
2019/08/12	菜油	7400	O1909	7208	0.54%	-192.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			O1001	7285	0.52%	-115.00	贴水扩大	
2019/08/12	菜粕	2443	RM909	2489	-0.08%	45.67	升水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2327	-0.13%	-116.33	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 2019/8/13		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）	8925.9900	8965.0500	-39.0600
	沪股通净流入（亿元）	3.0151	-0.4678	3.4829
	深股通净流入（亿元）	19.3766	14.4168	4.9598
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6978	2.6497	0.0481
	银行间质押式回购（7天）	2.7632	2.6470	0.1162
	Shibor（1天）	2.6290	2.5960	0.0330
	Shibor（7天）	2.6560	2.6440	0.0120
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8500	2.6700	0.1800
	深市质押式回购	2.7000	2.7500	-0.0500
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，两市成交依旧低迷，北向资金持续净流入，上证综指重回年线，期指IC或轻仓试多。			
化工品操作建议	NR合约首日如期上涨，上升高度或有限，RU合约1-9正套持有。			
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。