

2019年8月15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:
2019/08/14	IF	3682.4	IF1908	3673.4	0.58%	-9.00	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3653.6	0.55%	-28.80	贴水缩窄	
2019/08/14	IC	4683.8	IC1908	4672	0.54%	-11.84	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4617.2	0.71%	-66.64	贴水缩窄	
2019/08/14	IH	2804.4	IH1909	2784.6	0.53%	-19.76	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2784.6	0.53%	-19.76	贴水缩窄	
2019/08/14	TS	2.6959	TS1909	100.44	-0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.32	0.00%	-	-	
2019/08/14	TF	2.91	TF1909	100.27	-0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	100.12	-0.02%	-	-	
2019/08/14	T	3.0105	T1909	99.305	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	99.02	0.00%	-	-	
2019/08/13	铁矿	787.65	I1909	729.5	2.53%	-58.15	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	631.5	0.64%	-156.15	贴水扩大	
2019/08/14	螺纹	3825	RB1910	3670	-0.19%	-154.74	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3451	0.32%	-373.74	贴水缩窄	
2019/08/14	LLDPE	7550	L1909	7495	-0.66%	-55.00	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	7515	-0.92%	-35.00	贴水扩大	
2019/08/14	PP	8700	PP1909	8583	0.53%	-117.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	8184	0.42%	-516.00	贴水扩大	
2019/08/14	棕榈油	4730	P1909	4676	-0.97%	-54.00	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	4820	-0.86%	90.00	升水缩窄	
2019/08/14	焦煤	1710	JM1909	1395	-1.34%	-315.00	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	1313	-1.13%	-397.00	贴水扩大	
2019/08/14	焦炭	2247	J1909	2045.5	-0.37%	-201.81	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	1969	-0.76%	-278.31	贴水扩大	
2019/08/13	动力煤	581	ZC909	579	1.01%	-2.00	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	572	1.24%	-9.00	贴水扩大	
2019/08/14	PTA	5355	TA909	5368	2.60%	13.00	升水扩大	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5250	1.86%	-105.00	升水扩大	
2019/08/14	MA	2105	MA909	2128	-0.84%	23.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2252	-0.97%	147.00	升水缩窄	
2019/08/14	橡胶	10300	RU1910	10555	1.10%	255.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11525	1.45%	1225.00	升水扩大	
2019/08/14	豆油	5960	Y1909	6012	-1.38%	52.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	6144	-1.00%	184.00	升水缩窄	
2019/08/14	豆粕	2950	M1909	2891	-1.93%	-59.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2891	-1.93%	-59.00	贴水缩窄	
2019/08/14	菜油	7350	O1909	7205	-1.14%	-145.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			O1001	7301	-1.06%	-49.00	贴水扩大	
2019/08/14	菜粕	2432	RM909	2467	-2.06%	35.33	升水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2321	-2.27%	-110.67	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 DONGXING FUTURES 投资咨询部2019/8/15		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）	8945.3500	8940.7500	4.6000
	沪股通净流入（亿元）	-5.7192	-17.8220	12.1028
	深股通净流入（亿元）	17.5557	-6.5389	24.0946
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.7659	2.7545	0.0114
	银行间质押式回购（7天）	2.9157	2.9364	-0.0207
	Shibor（1天）	2.6890	2.6670	0.0220
	Shibor（7天）	2.6950	2.7030	-0.0080
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.9800	2.9900	-0.0100
	深市质押式回购	2.7000	2.7300	-0.0300
期指操作建议	明日期指交割，注意移仓，美债10年期与2年期收益率倒挂，全球市场避险情绪升级，期指多单暂避。			
期债操作建议	美债收益率倒挂，抬升避险情绪。期债T09注意移仓，T12偏多思路，关注支撑98.9。			
农产品操作建议	SR2001受新榨季套保压力较大，短期缺乏继续上行的动力。中期来看，我们对国内糖市供需的预估在进口符合预期的情况下为紧平衡，因此第三季度的进口数据将格外重要。若进口数据低于预期，则我们认为郑糖后期依然有可能走出独立行情。郑糖震荡运行趋势预计将反复，警惕回调风险，建议观望，或以日内短线操作为主。			
化工品操作建议	RU合约1-9正套继续持有，RU01与NR02价差扩大，可入场多NR空RU组合。			
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。