



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年8月16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:
2019/08/15	IF	3694	IF1908	3688.4	0.41%	-5.60	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3674.6	0.57%	-19.40	贴水缩窄	
2019/08/15	IC	4706.6	IC1908	4701.8	0.64%	-4.75	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4652.6	0.77%	-53.95	贴水缩窄	
2019/08/15	IH	2814.4	IH1909	2794.8	0.37%	-19.59	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2794.8	0.37%	-19.59	贴水缩窄	
2019/08/15	TS	2.7093	TS1909	100.41	-0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.29	-0.03%	-	-	
2019/08/15	TF	2.9182	TF1909	100.205	-0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	100.06	-0.06%	-	-	
2019/08/15	T	3.0115	T1909	99.185	-0.12%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.925	-0.10%	-	-	
2019/08/14	铁矿	796.41	I1909	723.5	-0.82%	-72.91	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	618	-2.14%	-178.41	贴水扩大	
2019/08/15	螺纹	3825	RB1910	3715	1.23%	-109.74	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3470	0.55%	-354.74	贴水缩窄	
2019/08/15	LLDPE	7500	L1909	7450	-0.60%	-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	7505	-0.13%	5.00	升水扩大	
2019/08/15	PP	8700	PP1909	8540	-0.50%	-160.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	8129	-0.67%	-571.00	贴水扩大	
2019/08/15	棕榈油	4720	P1909	4646	-0.64%	-74.00	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	4780	-0.83%	60.00	升水缩窄	
2019/08/15	焦煤	1710	JM1909	1391.5	-0.25%	-318.50	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	1328	1.14%	-382.00	贴水缩窄	
2019/08/15	焦炭	2349	J1909	2049.5	0.20%	-299.96	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	1981.5	0.63%	-367.96	贴水扩大	
2019/08/15	动力煤	577	ZC909	580.6	0.28%	3.60	升水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	574	0.35%	-3.00	贴水缩窄	
2019/08/15	PTA	5300	TA909	5290	-1.45%	-10.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5176	-1.41%	-124.00	升水缩窄	
2019/08/15	MA	2095	MA909	2116	-0.56%	21.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2234	-0.80%	139.00	升水缩窄	
2019/08/14	橡胶	10300	RU1910	10465	-0.85%	165.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11525	0.00%	1225.00	升水缩窄	
2019/08/15	豆油	6000	Y1909	6006	-0.10%	6.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	6134	-0.16%	134.00	升水缩窄	
2019/08/15	豆粕	2950	M1909	2875	-0.55%	-75.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2875	-0.55%	-75.00	贴水扩大	
2019/08/15	菜油	7350	O1909	7215	0.14%	-135.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1001	7308	0.10%	-42.00	贴水缩窄	
2019/08/15	菜粕	2432	RM909	2456	-0.45%	23.78	升水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2309	-0.52%	-123.22	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		2019/8/16		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）	8954.3900	8945.3500	9.0400	
	沪股通净流入（亿元）	-6.9858	-5.7192	-1.2666	
	深股通净流入（亿元）	8.3582	17.5557	-9.1975	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.7166	2.7659	-0.0493	
	银行间质押式回购（7天）	2.8633	2.9157	-0.0524	
	Shibor（1天）	2.6590	2.6890	-0.0300	
	Shibor（7天）	2.6780	2.6950	-0.0170	
二级市场流动性	沪市质押式回购	3.0100	2.9800	0.0300	
	深市质押式回购	3.3200	2.7000	0.6200	
期指操作建议	今日期指交割，注意移仓，期指震荡趋势或延续，谨慎者多单暂避。				
化工品操作建议	7月商用车销量28.1万吨，同比下降12.7%，RU合约1-9正套继续持有。				
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。