

2019年8月28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	
2019/08/27	IF	3816.9	IF1909	3803.4	1.10%	-13.55	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1910	3795	1.08%	-21.95	贴水扩大	
2019/08/27	IC	4936.1	IC1909	4874.4	1.23%	-61.72	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1910	4838	1.43%	-98.12	贴水扩大	
2019/08/27	IH	2887.2	IH1909	2880.4	0.70%	-6.84	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1910	2874.2	0.74%	-13.04	贴水扩大	
2019/08/27	TS	2.7159	TS1909	100.465	0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.32	0.00%	-	-	
2019/08/27	TF	2.9508	TF1909	100.335	-0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	100.04	0.03%	-	-	
2019/08/27	T	3.052	T1909	99.27	-0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.915	0.08%	-	-	
2019/08/26	铁矿	761.11	I1909	693.5	-0.93%	-67.61	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	586	-1.26%	-175.11	贴水扩大	
2019/08/27	螺纹	3701	RB1910	3575	-2.40%	-126.03	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3281	-2.70%	-420.03	贴水扩大	
2019/08/27	LLDPE	7150	L1909	7170	-0.69%	20.00	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	7225	-0.96%	75.00	升水缩窄	
2019/08/27	PP	8650	PP1909	8474	-0.07%	-176.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	7868	-0.52%	-782.00	贴水扩大	
2019/08/27	棕榈油	4960	P1909	4754	-3.41%	-206.00	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	4864	-2.49%	-96.00	贴水扩大	
2019/08/27	焦煤	1710	JM1909	1401	-0.36%	-309.00	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	1298.5	-0.19%	-411.50	贴水扩大	
2019/08/27	焦炭	2247	J1909	1945.5	-1.29%	-301.81	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	1875.5	-0.40%	-371.81	贴水扩大	
2019/08/27	动力煤	586	ZC909	584.4	-0.31%	-1.60	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	578	0.35%	-8.00	贴水缩窄	
2019/08/27	PTA	5145	TA909	5152	0.43%	7.00	升水扩大	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5108	0.27%	-37.00	升水扩大	
2019/08/27	MA	2000	MA909	2003	-1.38%	3.00	升水扩大	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2117	-1.17%	117.00	升水扩大	
2019/08/27	橡胶	10350	RU1910	10545	0.33%	195.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11535	0.30%	1185.00	升水扩大	
2019/08/27	豆油	6150	Y1909	6012	-2.34%	-138.00	贴水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	6128	-2.14%	-22.00	贴水扩大	
2019/08/27	豆粕	3100	M1909	2932	-1.31%	-168.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2932	-1.31%	-168.00	贴水扩大	
2019/08/27	菜油	7660	O1909	7358	-1.43%	-302.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			O1001	7425	-1.60%	-235.00	贴水扩大	
2019/08/27	菜粕	2440	RM909	2407	-2.87%	-33.00	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2365	-1.58%	-75.00	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 2019/8/28		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）	9192.9800	9156.1900	36.7900
	沪股通净流入（亿元）	71.0002	-23.4720	94.4722
	深股通净流入（亿元）	41.7096	-6.8653	48.5749
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.7240	2.6912	0.0328
	银行间质押式回购（7天）	2.9319	2.9303	0.0016
	Shibor（1天）	2.6770	2.6390	0.0380
	Shibor（7天）	2.6870	2.6690	0.0180
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.9450	2.8300	0.1150
	深市质押式回购	2.8800	2.6000	0.2800
期指操作建议	昨日北向资金净流入112.71亿元，MSCI第二次扩容实施，上证综指突破2900，但后市上行趋势或难延续，震荡依旧，谨慎者建议期指多单暂避。			
期债操作建议	基准利率料保持稳健，期债T09高位整理，多单谨持。			
化工操作建议	沪胶近期强势，空单可离场，轻仓逢低做多，01沪胶关注11920压制。			
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。