

2019年9月2日

投资咨询部

### 一、隔夜基差表

东兴期货 投资咨询部		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	
2019/08/30	IF	3799.6	IF1908	0	#DIV/0!	-3799.59	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3791.8	0.25%	-7.79	贴水扩大	
2019/08/30	IC	4886.5	IC1908	0	#DIV/0!	-4886.49	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4859	-0.66%	-27.49	贴水缩窄	
2019/08/30	IH	2872.4	IH1909	2860	0.39%	-12.40	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2860	0.39%	-12.40	贴水扩大	
2019/08/30	TS	2.7013	TS1909	100.415	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.285	-0.06%	-	-	
2019/08/30	TF	2.9627	TF1909	100.485	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	100	-0.17%	-	-	
2019/08/30	T	3.0573	T1909	99.24	-0.16%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.935	-0.30%	-	-	
2019/08/30	铁矿	760.63	I1909	725	3.42%	-35.63	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	607.5	4.74%	-153.13	贴水缩窄	
2019/08/30	螺纹	3711	RB1910	3644	1.59%	-67.34	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3350	2.57%	-361.34	贴水缩窄	
2019/08/30	LLDPE	7100	L1909	7070	0.78%	-30.00	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	7135	1.13%	35.00	升水扩大	
2019/08/30	PP	8580	PP1909	8520	0.92%	-60.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	7939	1.95%	-641.00	贴水缩窄	
2019/08/30	棕榈油	4770	P1909	4638	-2.15%	-132.00	贴水缩窄	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	4774	-1.61%	4.00	升水扩大	
2019/08/30	焦煤	1710	JM1909	1438	2.35%	-272.00	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	1308	1.36%	-402.00	贴水缩窄	
2019/08/30	焦炭	2247	J1909	1859	-1.77%	-388.31	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	1891	1.80%	-356.31	贴水缩窄	
2019/08/30	动力煤	581	ZC909	570	-0.97%	-11.00	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	571.6	0.56%	-9.40	贴水缩窄	
2019/08/30	PTA	5130	TA909	5084	-0.31%	-46.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5102	0.55%	-28.00	升水扩大	
2019/08/30	MA	2000	MA909	1997	-0.99%	-3.00	贴水扩大	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2140	-0.19%	140.00	升水扩大	
2019/08/30	橡胶	10300	RU1910	10780	0.94%	480.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11815	1.50%	1515.00	升水扩大	
2019/08/30	豆油	5950	Y1909	5930	-1.23%	-20.00	贴水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	6056	-1.21%	106.00	升水缩窄	
2019/08/30	豆粕	3100	M1909	2979	-1.29%	-121.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2979	-1.29%	-121.00	贴水扩大	
2019/08/30	菜油	7660	O1909	7376	0.08%	-284.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1001	7456	-0.08%	-204.00	贴水扩大	
2019/08/30	菜粕	2428	RM909	2449	0.53%	21.22	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2354	-1.75%	-73.78	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

 <b>东兴期货</b> 投资咨询部      2019/9/2		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）	9272.9200	9241.0000	31.9200
	沪股通净流入（亿元）	40.4085	3.2144	37.1941
	深股通净流入（亿元）	26.7870	0.6173	26.1697
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6363	2.5153	0.1210
	银行间质押式回购（7天）	2.8098	2.8469	-0.0371
	Shibor（1天）	2.5720	2.4780	0.0940
	Shibor（7天）	2.6650	2.6702	-0.0052
二级市场流动性	沪市质押式回购	3.0550	3.0350	0.0200
	深市质押式回购	2.6100	2.9000	-0.2900
期债操作建议	金融委和证监会相继发声，稳定市场预期，加大逆周期调节力度，期指IC09可轻仓试多。			
化工品操作建议	进入交割月，沪胶或弱势下跌，01沪胶关注11500支撑。			
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。