

2019年9月3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	
2019/09/02	IF	3848.3	IF1908	0	#DIV/0!	-3848.32	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1909	3832.6	1.08%	-15.72	贴水扩大	
2019/09/02	IC	5008.3	IC1908	0	#DIV/0!	-5008.30	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1909	4977.4	2.44%	-30.90	贴水缩窄	
2019/09/02	IH	2895	IH1909	2879	0.66%	-15.96	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2879	0.66%	-15.96	贴水扩大	
2019/09/02	TS	2.7079	TS1909	100.4	-0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.275	-0.01%	-	-	
2019/09/02	TF	2.9773	TF1909	100.19	-0.29%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.925	-0.08%	-	-	
2019/09/02	T	3.0723	T1909	99.09	-0.15%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.775	-0.16%	-	-	
2019/08/30	铁矿	760.63	I1909	747	3.03%	-13.63	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	630	3.70%	-130.63	贴水缩窄	
2019/09/02	螺纹	3753	RB1910	3702	1.59%	-50.58	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3407	1.70%	-345.58	贴水缩窄	
2019/09/02	LLDPE	7150	L2001	7185	0.70%	35.00	升水扩大	完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海
			L2005	7160	0.49%	10.00	升水缩窄	
2019/09/02	PP	8580	PP2001	7997	0.73%	-583.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP料(T30S):余姚
			PP2005	7626	0.62%	-954.00	贴水扩大	
2019/09/02	棕榈油	4840	P2001	4870	2.01%	30.00	升水扩大	交货价:棕榈油:天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P2005	5034	1.70%	194.00	升水扩大	
2019/09/02	焦煤	1710	JM2001	1315.5	0.57%	-394.50	贴水扩大	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM2005	1252.5	0.08%	-457.50	贴水扩大	
2019/09/02	焦炭	2145	J2001	1916	1.32%	-229.16	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
			J2005	1856.5	1.14%	-288.66	贴水缩窄	
2019/08/30	动力煤	581	ZC909	574	0.70%	-7.00	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	575	0.59%	-6.00	贴水缩窄	
2019/09/02	PTA	5110	TA001	5096	-0.12%	-14.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	5020	-0.28%	-90.00	升水缩窄	
2019/09/02	MA	2060	MA001	2209	3.22%	149.00	升水扩大	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA005	2191	1.81%	131.00	升水缩窄	
2019/09/02	橡胶	10300	RU1910	10750	-0.28%	450.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	11750	-0.55%	1450.00	升水缩窄	
2019/09/02	豆油	5950	Y2001	6090	0.56%	140.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2005	6046	0.53%	96.00	升水缩窄	
2019/09/02	豆粕	3150	M2001	2974	1.33%	-176.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	3016	1.24%	-134.00	贴水扩大	
2019/09/02	菜油	7660	OI001	7476	0.27%	-184.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			OI005	7425	0.31%	-235.00	贴水扩大	
2019/09/02	菜粕	2435	RM001	2395	1.74%	-40.00	贴水扩大	现货价:均价:菜粕
			RM005	2358	1.51%	-77.00	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 2019/9/3		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）	9263.4000	9272.9200	-9.5200
	沪股通净流入（亿元）	28.7352	40.4085	-11.6733
	深股通净流入（亿元）	24.3638	26.7870	-2.4232
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.5923	2.6363	-0.0440
	银行间质押式回购（7天）	2.7681	2.8098	-0.0417
	Shibor（1天）	2.5500	2.5720	-0.0220
	Shibor（7天）	2.6530	2.6650	-0.0120
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.9600	3.0550	-0.0950
	深市质押式回购	2.6500	2.6100	0.0400
期指操作建议	北向资金近五日净流入230亿元，上证综指重返2900点，本月第二次实施A股纳入MSCI比例提升，或带动北向资金进一步增加，期指IC09多单续持。			
化工品操作建议	橡胶目前供需驱动不足，以震荡市看待。			
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。