

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		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:
2019/09/03	IF	3853.6	IF1909	3835	0.06%	-18.61	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1910	3828	0.08%	-25.61	贴水扩大	
2019/09/03	IC	5044.2	IC1909	5004	0.53%	-40.18	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1910	4961	0.51%	-83.18	贴水扩大	
2019/09/03	IH	2892.2	IH1909	2879.8	0.03%	-12.38	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1909	2879.8	0.03%	-12.38	贴水缩窄	
2019/09/03	TS	2.6981	TS1909	100.39	-0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.26	-0.01%	-	-	
2019/09/03	TF	2.9748	TF1909	100.1	-0.09%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.885	-0.04%	-	-	
2019/09/03	T	3.0624	T1909	99.09	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.745	-0.03%	-	-	
2019/09/02	铁矿	791.81	I2001	637.5	1.19%	-154.31	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	581.5	-0.26%	-210.31	贴水扩大	
2019/09/03	螺纹	3763	RB1910	3714	0.32%	-48.89	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3403	-0.12%	-359.89	贴水扩大	
2019/09/03	LLDPE	7150	L2001	7170	-0.21%	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
			L2005	7150	-0.14%	0.00	贴水扩大	
2019/09/03	PP	8550	PP2001	7978	-0.24%	-572.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7603	-0.30%	-947.00	贴水缩窄	
2019/09/03	棕榈油	4820	P2001	4838	-0.66%	18.00	升水缩窄	交货价: 棕榈油: 天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P2005	5006	-0.56%	186.00	升水缩窄	
2019/09/03	焦煤	1710	JM2001	1309	-0.49%	-401.00	贴水扩大	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产
			JM2005	1247.5	-0.40%	-462.50	贴水扩大	
2019/09/03	焦炭	2145	J2001	1886.5	-1.54%	-258.66	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
			J2005	1830	-1.43%	-315.16	贴水扩大	
2019/09/03	动力煤	581	ZC001	575	0.00%	-6.00	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	561.2	-0.07%	-19.80	贴水扩大	
2019/09/03	PTA	5120	TA001	5116	0.39%	-4.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	5028	0.16%	-92.00	升水缩窄	
2019/09/03	MA	2075	MA001	2209	0.00%	134.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2192	0.05%	117.00	升水缩窄	
2019/09/03	橡胶	10650	RU1910	10950	1.86%	300.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	11935	1.57%	1285.00	升水扩大	
2019/09/03	豆油	5880	Y2001	6052	-0.62%	172.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6012	-0.56%	132.00	升水扩大	
2019/09/03	豆粕	3150	M2001	2995	0.71%	-155.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	2995	0.71%	-155.00	贴水缩窄	
2019/09/03	菜油	7660	OI001	7418	-0.78%	-242.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7395	-0.40%	-265.00	贴水扩大	
2019/09/03	菜粕	2435	RM001	2407	0.50%	-28.00	贴水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2366	0.34%	-69.00	贴水缩窄	

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2019/9/4		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）	9314.3300	9263.4000	50.9300
	沪股通净流入（亿元）	10.0593	28.7352	-18.6759
	深股通净流入（亿元）	-9.8727	24.3638	-34.2365
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.5507	2.5923	-0.0416
	银行间质押式回购（7天）	2.7237	2.7681	-0.0444
	Shibor（1天）	2.5130	2.5500	-0.0370
	Shibor（7天）	2.6100	2.6530	-0.0430
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8200	2.9600	-0.1400
	深市质押式回购	1.2000	2.6500	-1.4500
期指操作建议	北向资金持续净流入，期指IC09多单续持。			
化工品操作建议	期现价差有所拉大，沪胶上方空间受套利抑制，01沪胶关注11500支撑。装置利润维持高位且检修即将结束，EG01空单逢高入场。			
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。