



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年9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:
2019/09/12	IF	3972.4	IF1909	3976.8	1.09%	4.42	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1910	3978.4	1.12%	6.02	升水扩大	
2019/09/12	IC	5242.6	IC1909	5240.2	0.43%	-2.41	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1910	5213	0.59%	-29.61	贴水缩窄	
2019/09/12	IH	2999.6	IH1909	3000.8	1.38%	1.24	升水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1910	2999.4	1.33%	-0.16	贴水扩大	
2019/09/12	TS	2.7059	TS1909	100.415	-0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	100.275	-0.05%	-	-	
2019/09/12	TF	2.9802	TF1909	100.16	-0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.845	-0.16%	-	-	
2019/09/12	T	3.0876	T1909	99.01	-0.22%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	98.49	-0.29%	-	-	
2019/09/12	铁矿	831.33	I2001	680	2.87%	-151.33	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	594.5	1.89%	-236.83	贴水扩大	
2019/09/12	螺纹	3835	RB1910	3841	1.21%	5.95	升水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3549	1.95%	-286.05	贴水缩窄	
2019/09/12	LLDPE	7300	L2001	7290	-0.27%	-10.00	贴水扩大	完税自提价(低端价): 线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级): 上海
			L2005	7185	-0.35%	-115.00	贴水扩大	
2019/09/12	PP	8650	PP2001	8081	-0.53%	-569.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7698	-0.27%	-952.00	贴水扩大	
2019/09/12	棕榈油	4710	P2001	4784	-1.32%	74.00	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	4990	-1.07%	280.00	升水缩窄	
2019/09/12	焦煤	1710	JM2001	1358	0.59%	-352.00	贴水缩窄	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产
			JM2005	1277	0.31%	-433.00	贴水缩窄	
2019/09/12	焦炭	2145	J2001	2005	1.52%	-140.16	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	1926	1.32%	-219.16	贴水缩窄	
2019/09/12	动力煤	583	ZC001	581.6	-0.21%	-1.40	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	569.2	-0.14%	-13.80	贴水扩大	
2019/09/12	PTA	5080	TA001	5098	-0.47%	18.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	5048	-0.36%	-32.00	升水扩大	
2019/09/12	MA	2105	MA001	2248	0.13%	143.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2234	0.04%	129.00	升水扩大	
2019/09/12	橡胶	11000	RU1910	11010	0.23%	10.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	11915	-0.71%	915.00	升水扩大	
2019/09/12	豆油	5870	Y2001	6054	-0.20%	184.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	5998	-0.30%	128.00	升水扩大	
2019/09/12	豆粕	3080	M2001	2858	0.63%	-222.00	贴水缩窄	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	2858	0.63%	-222.00	贴水缩窄	
2019/09/12	菜油	7630	OI001	7336	-0.20%	-294.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7313	-0.18%	-317.00	贴水缩窄	
2019/09/12	菜粕	2372	RM001	2260	0.71%	-111.67	贴水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2288	0.48%	-83.67	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		2019/9/16		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）	9650.5928	9617.8900	32.7028	
	沪股通净流入（亿元）	0.0000	24.8884	-24.8884	
	深股通净流入（亿元）	8.0664	6.2708	1.7956	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.4116	2.5051	-0.0935	
	银行间质押式回购（7天）	2.7373	2.7614	-0.0241	
	Shibor（1天）	2.3690	2.4510	-0.0820	
	Shibor（7天）	2.6500	2.6450	0.0050	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7150	2.6550	0.0600	
	深市质押式回购	2.5000	1.0000	1.5000	
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，今日公布8月经济运行数据，降准正式实施，期指IC09多单续持。				
化工操作建议	原油上涨利多橡胶，沪胶或继续震荡偏强。				
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。