

2019年9月17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		
2019/09/16	IF	3957.7	IF1909	3959.8	-0.43%	2.08	升水缩窄	现货价格: 沪深300指数	
			IF1910	3958.4	-0.50%	0.68	升水缩窄		
2019/09/16	IC	5250.3	IC1909	5237.4	-0.05%	-12.94	贴水扩大	现货价格: 中证500指数	
			IC1910	5207.2	-0.11%	-43.14	贴水扩大		
2019/09/16	IH	2982.4	IH1909	2984.6	-0.54%	2.15	升水扩大	现货价格: 上证50指数	
			IH1910	2981.2	-0.61%	-1.25	贴水扩大		
2019/09/16	TS	2.6968	TS1909	100.415	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)	
			TS1912	100.295	0.02%	-	-		
2019/09/16	TF	2.9769	TF1909	100.16	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)	
			TF1912	99.9	0.06%	-	-		
2019/09/16	T	3.0926	T1909	99.01	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)	
			T1912	98.59	0.10%	-	-		
2019/09/16	铁矿	835.46	I2001	670.5	-1.40%	-164.96	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价	
			I2005	594.5	0.00%	-240.96	贴水扩大		
2019/09/16	螺纹	3876	RB1910	3840	-0.03%	-36.29	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格	
			RB2001	3564	0.42%	-312.29	贴水扩大		
2019/09/16	LLDPE	7550	L2001	7630	4.66%	80.00	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	7440	3.55%	-110.00	贴水缩窄		
2019/09/16	PP	8800	PP2001	8353	3.37%	-447.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚	
			PP2005	7970	3.53%	-830.00	贴水缩窄		
2019/09/16	棕榈油	4770	P2001	4884	2.09%	114.00	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	5104	2.28%	334.00	升水扩大		
2019/09/16	焦煤	1710	JM2001	1357.5	-0.04%	-352.50	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	1285	0.63%	-425.00	贴水缩窄		
2019/09/16	焦炭	2145	J2001	1994	-0.55%	-151.16	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	1920.5	-0.29%	-224.66	贴水扩大		
2019/09/16	动力煤	583	ZC001	582.6	0.17%	-0.40	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛	
			ZC005	569.2	0.00%	-13.80	贴水扩大		
2019/09/16	PTA	5240	TA001	5270	3.37%	30.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘	
			TA005	5194	2.89%	-46.00	升水缩窄		
2019/09/16	MA	2205	MA001	2347	4.40%	142.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐	
			MA005	2315	3.63%	110.00	升水缩窄		
2019/09/16	橡胶	11150	RU1910	11100	0.82%	-50.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海	
			RU2001	12035	1.01%	885.00	升水扩大		
2019/09/16	豆油	5910	Y2001	6114	0.99%	204.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连	
			Y2005	6092	1.57%	182.00	升水扩大		
2019/09/16	豆粕	3030	M2001	2845	-0.45%	-185.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连	
			M2005	2845	-0.45%	-185.00	贴水缩窄		
2019/09/16	菜油	7630	OI001	7361	0.34%	-269.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽	
			OI005	7342	0.40%	-288.00	贴水缩窄		
2019/09/16	菜粕	2368	RM001	2251	-0.40%	-117.33	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕	
			RM005	2292	0.17%	-76.33	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

 <b>东兴期货</b> 投资咨询部      2019/9/17		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）	9605.0300	9650.5928	-45.5628
	沪股通净流入（亿元）	4.1871	0.0000	4.1871
	深股通净流入（亿元）	4.9123	8.0664	-3.1541
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.3853	2.4116	-0.0263
	银行间质押式回购（7天）	2.7172	2.7373	-0.0201
	Shibor（1天）	2.3360	2.3690	-0.0330
	Shibor（7天）	2.6420	2.6500	-0.0080
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7600	2.7150	0.0450
	深市质押式回购	2.7500	2.5000	0.2500
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，8月经济数据不及预期，北向资金持续净流入，期指IC09多单谨持，关注MLF利率信号。			
化工操作建议	受沙特遇袭影响沥青盘面上行，12沥青关注3400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。