

2019年9月23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		
2019/09/20	IF	3935.7	IF1909	3932	0.18%	-3.65	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数	
			IF1910	3926	0.13%	-9.65	贴水扩大		
2019/09/20	IC	5204.5	IC1909	5203.6	0.35%	-0.88	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数	
			IC1910	5147.4	-0.06%	-57.08	贴水扩大		
2019/09/20	IH	2963.4	IH1909	2964	0.20%	0.57	升水缩窄	现货价格: 上证50指数	
			IH1910	2961.4	0.17%	-2.03	贴水扩大		
2019/09/20	TS	2.707	TS1909	0	#DIV/0!	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)	
			TS1912	100.285	0.00%	-	-		
2019/09/20	TF	2.9894	TF1912	99.9	0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)	
			TF2003	99.64	0.04%	-	-		
2019/09/20	T	3.098	T1912	98.535	0.11%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)	
			T2003	98.185	0.08%	-	-		
2019/09/20	铁矿	794.88	I2001	635	-0.39%	-159.88	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价	
			I2005	559.5	-0.80%	-235.38	贴水缩窄		
2019/09/20	螺纹	3794	RB1910	3691	-1.34%	-102.81	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格	
			RB2001	3388	-0.26%	-405.81	贴水缩窄		
2019/09/20	LLDPE	7750	L2001	7640	-0.65%	-110.00	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	7380	-0.61%	-370.00	贴水扩大		
2019/09/20	PP	8830	PP2001	8221	0.33%	-609.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚	
			PP2005	7861	0.40%	-969.00	贴水缩窄		
2019/09/20	棕榈油	4700	P2001	4790	-0.62%	90.00	贴水扩大	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	5048	-0.63%	348.00	升水缩窄		
2019/09/20	焦煤	1710	JM2001	1296	-1.74%	-414.00	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	1217	-2.64%	-493.00	贴水扩大		
2019/09/20	焦炭	2145	J2001	1939	-1.20%	-206.16	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	1847	-1.65%	-298.16	贴水扩大		
2019/09/20	动力煤	585	ZC001	576.4	-0.96%	-8.60	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛	
			ZC005	564.6	-0.67%	-20.40	贴水扩大		
2019/09/20	PTA	5065	TA001	5142	0.35%	77.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘	
			TA005	5126	0.08%	61.00	升水缩窄		
2019/09/20	MA	2180	MA001	2316	0.74%	136.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐	
			MA005	2266	0.27%	86.00	升水缩窄		
2019/09/20	橡胶	11000	RU1910	11010	-0.68%	10.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海	
			RU2001	11870	0.47%	870.00	升水扩大		
2019/09/20	豆油	5920	Y2001	6034	-0.53%	114.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连	
			Y2005	6052	-0.79%	132.00	升水扩大		
2019/09/20	豆粕	3050	M2001	2863	0.03%	-187.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连	
			M2001	2863	0.03%	-187.00	贴水扩大		
2019/09/20	菜油	7630	OI001	7316	-0.25%	-314.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽	
			OI005	7296	-0.30%	-334.00	贴水扩大		
2019/09/20	菜粕	2374	RM001	2267	-0.22%	-106.89	贴水扩大	现货价:均价:菜粕	
			RM005	2299	-0.30%	-74.89	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 2019/9/23		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）	9737.6400	9705.8700	31.7700
	沪股通净流入（亿元）	71.3707	3.7733	67.5974
	深股通净流入（亿元）	77.2527	23.1525	54.1002
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.8588	2.8151	0.0437
	银行间质押式回购（7天）	3.0274	2.9072	0.1202
	Shibor（1天）	2.7460	2.7370	0.0090
	Shibor（7天）	2.7310	2.7090	0.0220
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8450	2.8600	-0.0150
	深市质押式回购	2.8700	2.3000	0.5700
期债操作建议	长期LPR不动，公开市场逆回购提供跨节资金，期债T12节前维持高位整理。			
化工品操作建议	临近假期，下游需求阶段性走低，沪胶或震荡偏弱。沙特遇袭导致L和MEG原料减少，短线支撑增强，关注L-PP价差修复机会。			
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。