



2019年3月8日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货		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	
2019/03/07	IF	3808.8	IF1903	3808.8	-0.98%	-0.05	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1904	3817.2	-0.93%	8.35	升水扩大	
2019/03/07	IC	5458.6	IC1903	5442.4	0.79%	-16.22	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1904	5431	0.67%	-27.62	贴水扩大	
2019/03/07	IH	2789.7	IH1903	2794.4	-1.54%	4.70	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1904	2801.6	-1.55%	11.90	升水扩大	
2019/03/07	TS	2.6059	TS1903	101	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1906	100.295	0.02%	-	-	
2019/03/07	TF	3.0454	TF1903	99.665	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1906	99.47	0.29%	-	-	
2019/03/07	T	3.1572	T1903	98.6	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1906	97.73	0.51%	-	-	
2019/03/06	铁矿	677.11	I1905	623.5	2.13%	-53.61	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I1909	585.5	2.72%	-91.61	贴水扩大	
2019/03/07	螺纹	3969	RB1905	3821	2.25%	-148.07	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB1909	3685	1.46%	-284.07	贴水缩窄	
2019/03/07	LLDPE	8750	L1905	8710	-0.85%	-40.00	贴水缩窄	完税自提价(低端价): 线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海
			L1909	8545	-0.52%	-205.00	贴水缩窄	
2019/03/07	PP	8900	PP1905	8808	-1.33%	-92.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S):余姚
			PP1909	8567	-1.19%	-333.00	贴水缩窄	
2019/03/07	棕榈油	4480	P1905	4582	-0.78%	102.00	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
			P1909	4772	-0.58%	292.00	升水扩大	
2019/03/07	焦煤	1710	JM1905	1272.5	0.47%	-437.50	贴水缩窄	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM1909	1370	0.29%	-340.00	贴水缩窄	
2019/03/07	焦炭	2349	J1905	2080	0.80%	-269.46	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
			J1909	2027	1.25%	-322.46	贴水缩窄	
2019/03/07	动力煤	560	ZC905	613.2	-0.39%	53.20	升水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC909	587.8	-0.17%	27.80	升水扩大	
2019/03/07	PTA	6820	TA905	6724	-0.53%	-96.00	升水扩大	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA909	6380	-1.15%	-440.00	升水扩大	
2019/03/07	MA	2570	MA905	2584	-2.78%	14.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA909	2630	-2.16%	60.00	升水缩窄	
2019/03/07	橡胶	11550	RU1905	12215	-1.85%	665.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU1909	12475	-1.58%	925.00	升水扩大	
2019/03/07	豆油	5900	Y1905	5718	-1.38%	-182.00	贴水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y1909	5814	-1.36%	-86.00	贴水缩窄	
2019/03/07	豆粕	2620	M1905	2525	0.72%	-95.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2525	0.72%	-95.00	贴水缩窄	
2019/03/07	菜油	7050	O1905	7049	-0.62%	-1.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1909	7143	-1.12%	93.00	升水扩大	
2019/03/07	菜粕	2243	RM905	2180	0.14%	-63.33	贴水缩窄	现货价:均价:菜粕
			RM909	2206	-0.09%	-37.33	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

2019/03/08		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）	8426.1000	8292.3000	133.8000
	沪股通净流入（亿元）	-25.5021	-8.9538	-16.5483
	深股通净流入（亿元）	-14.1970	0.6078	-14.8048
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.1009	2.1168	-0.0159
	银行间质押式回购（7天）	2.3691	2.4181	-0.0490
	Shibor（1天）	2.0600	2.0740	-0.0140
	Shibor（7天）	2.5170	2.4880	0.0290
二级市场流动性	沪市质押式回购	1.9550	2.0750	-0.1200
	深市质押式回购	1.8010	1.2500	0.5510
期指操作建议	今日公布2月进出口数据，两市再创巨量成交1.17万亿，但北上资金净流出39.7亿元，连续两日净流出，建议期指多单暂避，关注沪深300指数5日均线争夺。			
化工操作建议	沪胶此波反弹殆尽，05沪胶关注12000-12300支撑。			
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。