



2019年4月17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	
2019/04/16	IF	4085.8	IF1904	4093	3.16%	7.21	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1905	4100	3.25%	14.21	升水扩大	
2019/04/16	IC	5777	IC1904	5759.2	2.68%	-17.81	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1905	5738	2.93%	-39.01	贴水缩窄	
2019/04/16	IH	3023	IH1904	3031.4	3.80%	8.37	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1905	3040.4	3.90%	17.37	升水扩大	
2019/04/16	TS	2.9432	TS1906	99.85	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	99.75	0.00%	-	-	
2019/04/16	TF	3.2565	TF1906	98.53	-0.11%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	98.305	-0.10%	-	-	
2019/04/16	T	3.3937	T1906	96.165	-0.21%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	95.76	-0.25%	-	-	
2019/04/16	铁矿	722.08	I1905	697	-2.04%	-25.08	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I1909	632.5	-3.14%	-89.58	贴水扩大	
2019/04/16	螺纹	4278	RB1905	4144	-0.60%	-134.35	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB1909	3879	-1.10%	-399.35	贴水缩窄	
2019/04/16	LLDPE	8500	L1905	8550	-0.23%	50.00	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
			L1909	8480	-0.24%	-20.00	贴水缩窄	
2019/04/16	PP	8950	PP1905	8882	-0.22%	-68.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S):余姚
			PP1909	8713	-0.19%	-237.00	贴水缩窄	
2019/04/16	棕榈油	4380	P1905	4424	-0.67%	44.00	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
			P1909	4644	-0.51%	264.00	升水扩大	
2019/04/16	焦煤	1710	JM1905	1220.5	-0.49%	-489.50	贴水扩大	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM1909	1319.5	-0.49%	-390.50	贴水扩大	
2019/04/16	焦炭	2094	J1905	2036.5	0.39%	-57.59	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	2061	0.54%	-33.09	贴水缩窄	
2019/04/16	动力煤	634	ZC905	621.6	0.39%	-12.40	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC909	594.8	-0.17%	-39.20	贴水缩窄	
2019/04/16	PTA	6600	TA905	6640	0.73%	40.00	升水扩大	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA909	6342	0.13%	-258.00	升水扩大	
2019/04/16	MA	2380	MA905	2383	-1.93%	3.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA909	2471	-1.04%	91.00	升水扩大	
2019/04/16	橡胶	11100	RU1905	11490	-1.46%	390.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU1909	11685	-1.31%	585.00	升水缩窄	
2019/04/16	豆油	5250	Y1905	5388	-0.63%	138.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y1909	5550	-0.50%	300.00	升水扩大	
2019/04/16	豆粕	2580	M1905	2546	0.24%	-34.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2546	0.24%	-34.00	升水扩大	
2019/04/16	菜油	7240	O1905	7012	0.01%	-228.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1909	7034	-0.11%	-206.00	贴水缩窄	
2019/04/16	菜粕	2237	RM905	2194	-0.18%	-43.22	贴水缩窄	现货价:均价:菜粕
			RM909	2231	0.18%	-6.22	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

2019/04/17		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）	9684.3000	9660.5000	23.8000
	沪股通净流入（亿元）	18.1861	-9.5620	27.7481
	深股通净流入（亿元）	16.1388	-13.1812	29.3200
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.9725	2.8709	0.1016
	银行间质押式回购（7天）	3.2348	3.0724	0.1624
	Shibor（1天）	2.8830	2.7970	0.0860
	Shibor（7天）	2.7870	2.7720	0.0150
二级市场流动性	沪市质押式回购	3.0550	2.5550	0.5000
	深市质押式回购	3.5000	1.8100	1.6900
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，今日公布一季度经济运行数据，北向资金重回净流入，流入额创月内新高，上证综指涨2.39%，外盘表现强劲，美国三大股指集体收高，期指多单持有。			
化工操作建议	3月汽车产销同比继续下降，但相比前两个月降幅明显缩窄，09沪胶大幅下跌至11500一线，空单继续持有。			
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研发中心所有。未获得东兴期货研发中心书面授权，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“东兴期货研发中心”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。