



2019年4月22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	
2019/04/19	IF	4120.6	IF1904	4091.6	0.52%	-29.01	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1905	4130.2	1.35%	9.59	升水扩大	
2019/04/19	IC	5810.2	IC1904	5781.2	0.28%	-28.98	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1905	5775.8	1.10%	-34.38	贴水缩窄	
2019/04/19	IH	3042.4	IH1904	3024	0.68%	-18.43	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1905	3050.6	1.23%	8.17	升水缩窄	
2019/04/19	TS	2.9089	TS1906	99.89	0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	99.75	0.00%	-	-	
2019/04/19	TF	3.2024	TF1906	98.725	-0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	98.495	0.06%	-	-	
2019/04/19	T	3.3741	T1906	96.39	-0.09%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	95.99	-0.11%	-	-	
2019/04/19	铁矿	711.02	I1905	693	0.87%	-18.02	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I1909	621.5	0.24%	-89.52	贴水缩窄	
2019/04/19	螺纹	4227	RB1905	4134	0.78%	-92.80	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB1909	3844	0.76%	-382.80	贴水缩窄	
2019/04/19	LLDPE	8450	L1905	8395	-0.24%	-55.00	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	8330	0.00%	-120.00	贴水缩窄	
2019/04/19	PP	8900	PP1905	8801	-0.16%	-99.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S):余姚
			PP1909	8649	0.29%	-251.00	贴水缩窄	
2019/04/19	棕榈油	4390	P1905	4416	0.55%	26.00	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	4616	0.57%	226.00	升水扩大	
2019/04/19	焦煤	1710	JM1905	1230	0.49%	-480.00	贴水缩窄	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM1909	1336.5	1.40%	-373.50	贴水缩窄	
2019/04/19	焦炭	2094	J1905	2037	1.34%	-57.09	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	2050	1.89%	-44.09	贴水缩窄	
2019/04/19	动力煤	626	ZC905	608.2	-0.72%	-17.80	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC909	588.2	0.07%	-37.80	贴水缩窄	
2019/04/19	PTA	6510	TA905	6394	-0.37%	-116.00	升水扩大	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA909	6006	0.03%	-504.00	升水扩大	
2019/04/19	MA	2340	MA905	2355	0.77%	15.00	升水扩大	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA909	2439	0.99%	99.00	升水扩大	
2019/04/19	橡胶	10950	RU1905	11240	0.58%	290.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU1909	11470	0.61%	520.00	升水扩大	
2019/04/19	豆油	5230	Y1905	5340	-0.07%	110.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y1909	5510	0.29%	280.00	升水扩大	
2019/04/19	豆粕	2580	M1905	2523	-0.04%	-57.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1905	2523	-0.04%	-57.00	升水扩大	
2019/04/19	菜油	7240	O1905	7040	0.38%	-200.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1909	6991	-0.04%	-249.00	贴水缩窄	
2019/04/19	菜粕	2237	RM905	2204	0.46%	-33.22	贴水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM909	2230	0.81%	-7.22	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**

2019/04/22		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）	9836.6000	9813.5000	23.1000
	沪股通净流入（亿元）	0.0000	0.0000	0.0000
	深股通净流入（亿元）	0.0000	0.0000	0.0000
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.6935	2.8558	-0.1623
	银行间质押式回购（7天）	2.7562	2.9758	-0.2196
	Shibor（1天）	2.6610	2.8120	-0.1510
	Shibor（7天）	2.6920	2.7500	-0.0580
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8650	2.7850	0.0800
	深市质押式回购	3.2500	1.9900	1.2600
期指操作建议	股指期货再次松绑，二季度进入分红季，期价将受到影响，期指多单持有，关注沪深300指数10日均线支撑。			
化工操作建议	沪胶大幅下跌后反弹，由于国内以及东南亚割胶后期逐步放量以及自身库存压力，反弹高度受限，预期维持低位震荡行情。			
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。