



2019年4月23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	
2019/04/22	IF	4025.6	IF1905	4020.2	-2.66%	-5.41	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1906	4017	-2.60%	-8.61	贴水扩大	
2019/04/22	IC	5723	IC1905	5677	-1.71%	-46.04	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1906	5633.6	-1.74%	-89.44	贴水扩大	
2019/04/22	IH	2970.5	IH1905	2980.4	-2.30%	9.91	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1906	2968.6	-2.28%	-1.89	贴水扩大	
2019/04/22	TS	2.9334	TS1906	99.845	-0.05%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	99.75	0.00%	-	-	
2019/04/22	TF	3.2231	TF1906	98.6	-0.13%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	98.36	-0.14%	-	-	
2019/04/22	T	3.4091	T1906	96.22	-0.18%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	95.745	-0.26%	-	-	
2019/04/19	铁矿	711.02	I1905	700	1.01%	-11.02	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I1909	627	0.88%	-84.02	贴水缩窄	
2019/04/22	螺纹	4299	RB1905	4150	0.39%	-148.97	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB1909	3875	0.81%	-423.97	贴水缩窄	
2019/04/22	LLDPE	8450	L1905	8385	-0.12%	-65.00	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	8295	-0.42%	-155.00	贴水缩窄	
2019/04/22	PP	8900	PP1905	8796	-0.06%	-104.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S):余姚
			PP1909	8643	-0.07%	-257.00	贴水缩窄	
2019/04/22	棕榈油	4390	P1905	4382	-0.77%	-8.00	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	4616	0.00%	226.00	贴水扩大	
2019/04/22	焦煤	1710	JM1905	1225	-0.41%	-485.00	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	1330.5	-0.45%	-379.50	贴水缩窄	
2019/04/22	焦炭	2094	J1905	2026	-0.54%	-68.09	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	2033.5	-0.80%	-60.59	贴水缩窄	
2019/04/22	动力煤	624	ZC905	611	0.46%	-13.00	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC909	596.8	1.46%	-27.20	贴水缩窄	
2019/04/22	PTA	6520	TA905	6510	1.81%	-10.00	升水扩大	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA909	6058	0.87%	-462.00	升水扩大	
2019/04/22	MA	2360	MA905	2373	0.76%	13.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA909	2457	0.74%	97.00	升水缩窄	
2019/04/22	橡胶	10950	RU1905	11275	0.31%	325.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU1909	11480	0.09%	530.00	升水扩大	
2019/04/22	豆油	5300	Y1905	5332	-0.15%	32.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y1909	5514	0.07%	214.00	升水扩大	
2019/04/22	豆粕	2580	M1905	2522	-0.04%	-58.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1905	2522	-0.04%	-58.00	贴水扩大	
2019/04/22	菜油	7240	O1905	7100	0.85%	-140.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1909	6996	0.07%	-244.00	贴水缩窄	
2019/04/22	菜粕	2243	RM905	2214	0.45%	-29.33	贴水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM909	2226	-0.18%	-17.33	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

2019/04/23		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）	9851.5000	9836.6000	14.9000
	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）	2.6013	2.6935	-0.0922
	银行间质押式回购（7天）	2.6746	2.7562	-0.0816
	Shibor（1天）	2.5570	2.6610	-0.1040
	Shibor（7天）	2.6540	2.6920	-0.0380
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7050	2.8650	-0.1600
	深市质押式回购	1.9000	3.2500	-1.3500
期指操作建议	市场宽松预期下降，A股单边下行，谨慎者期指多单暂避，关注沪深300指数4000点争夺。			
化工操作建议	目前20号胶上市工作正在积极推进，09沪胶弱势反弹，关注11350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。