



2019年4月30日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货		隔夜基差表						
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	注:
2019/04/29	IF	3900.3	IF1905	3914.8	0.60%	14.47	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1906	3902.4	0.57%	2.07	升水扩大	
2019/04/29	IC	5265.6	IC1905	5258.8	-2.17%	-6.80	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1906	5219.8	-2.21%	-45.80	贴水缩窄	
2019/04/29	IH	2939.4	IH1905	2944.6	1.59%	5.19	升水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1906	2930	1.62%	-9.41	贴水缩窄	
2019/04/29	TS	2.9223	TS1906	99.795	-0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	99.75	0.00%	-	-	
2019/04/29	TF	3.2199	TF1906	98.595	-0.13%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	98.36	-0.11%	-	-	
2019/04/29	T	3.4268	T1906	96.2	-0.18%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	95.775	-0.13%	-	-	
2019/04/26	铁矿	712.53	I1905	702	0.93%	-10.53	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I1909	634	2.51%	-78.53	贴水缩窄	
2019/04/29	螺纹	4268	RB1905	4194	1.04%	-74.04	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB1909	3883	1.09%	-385.04	贴水缩窄	
2019/04/29	LLDPE	8350	L1905	8350	-0.36%	0.00	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
			L1909	8285	-0.06%	-65.00	贴水缩窄	
2019/04/29	PP	8800	PP1905	8810	0.30%	10.00	升水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S):余姚
			PP1909	8605	0.31%	-195.00	贴水缩窄	
2019/04/29	棕榈油	4290	P1905	4244	0.47%	-46.00	贴水缩窄	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	4500	-0.09%	210.00	升水缩窄	
2019/04/29	焦煤	1710	JM1905	1212	1.81%	-498.00	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	1354.5	0.56%	-355.50	贴水缩窄	
2019/04/29	焦炭	2145	J1905	2048	1.06%	-97.16	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	2047	1.59%	-98.16	贴水缩窄	
2019/04/29	动力煤	618	ZC905	617.2	0.03%	-0.80	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC909	607.4	0.07%	-10.60	贴水缩窄	
2019/04/29	PTA	6575	TA905	6592	0.33%	17.00	升水扩大	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA909	5962	0.07%	-613.00	升水扩大	
2019/04/29	MA	0	MA905	2282	-0.35%	2282.00	升水扩大	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA909	2408	0.71%	2408.00	升水扩大	
2019/04/29	橡胶	10700	RU1905	11005	-0.18%	305.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU1909	11255	-0.13%	555.00	升水扩大	
2019/04/29	豆油	5270	Y1905	5188	-0.04%	-82.00	贴水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y1909	5358	-0.04%	88.00	升水扩大	
2019/04/29	豆粕	2580	M1905	2493	0.65%	-87.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2493	0.65%	-87.00	贴水缩窄	
2019/04/29	菜油	7140	O1905	6960	-0.40%	-180.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1909	6813	0.06%	-327.00	贴水缩窄	
2019/04/29	菜粕	2236	RM905	2183	0.65%	-53.11	贴水缩窄	现货价:均价:菜粕
			RM909	2185	0.60%	-51.11	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

2019/04/30		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）	9820.0000	9857.5000	-37.5000
	沪股通净流入（亿元）	38.1912	-18.4731	56.6643
	深股通净流入（亿元）	7.1361	8.0471	-0.9110
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.7182	2.0539	-0.3357
	银行间质押式回购（7天）	2.9334	2.7710	0.1624
	Shibor（1天）	1.7000	2.0700	-0.3700
	Shibor（7天）	2.6910	2.7050	-0.0140
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7200	3.1250	-0.4050
	深市质押式回购	0.7000	2.2010	-1.5010
期指操作建议	昨日盘面一九分化，中小板持续走弱，IC回落显著，节后或回归基本面，期指IC可多单持有。			
化工操作建议	弱势基本面延续，沪胶空单继续持有，09沪胶关注11000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。