



2019年5月15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	
2019/05/14	IF	3645.2	IF1905	3638.6	-0.51%	-6.55	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1906	3616	-0.46%	-29.15	贴水缩窄	
2019/05/14	IC	4965.6	IC1905	4938.8	0.01%	-26.81	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1906	4862.6	-0.13%	-103.01	贴水缩窄	
2019/05/14	IH	2724.7	IH1905	2721.4	-0.71%	-3.33	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1906	2704.4	-0.68%	-20.33	贴水扩大	
2019/05/14	TS	2.8734	TS1906	100.065	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	99.795	0.00%	-	-	
2019/05/14	TF	3.16	TF1906	99.175	-0.10%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	98.865	-0.08%	-	-	
2019/05/14	T	3.2859	T1906	97.29	-0.12%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	96.845	-0.15%	-	-	
2019/05/13	铁矿	738.25	I1909	644.5	-1.38%	-93.75	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	582	-2.18%	-156.25	贴水缩窄	
2019/05/14	螺纹	4144	RB1910	3663	-0.76%	-481.33	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3406	-0.70%	-738.33	贴水缩窄	
2019/05/14	LLDPE	7900	L1905	7620	-2.37%	-280.00	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	7695	-2.04%	-205.00	贴水扩大	
2019/05/14	PP	8500	PP1909	8137	-2.46%	-363.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S):余姚
			PP2001	7885	-2.49%	-615.00	贴水扩大	
2019/05/14	棕榈油	4210	P1909	4374	-0.18%	164.00	升水缩窄	交货价: 棕榈油:天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P2001	4578	0.22%	368.00	贴水扩大	
2019/05/14	焦煤	1710	JM1909	1337	-1.00%	-373.00	贴水扩大	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM2001	1301.5	-0.91%	-408.50	贴水扩大	
2019/05/14	焦炭	2298	J1909	2091	-1.67%	-207.39	贴水扩大	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
			J2001	2027.5	-1.65%	-270.89	贴水扩大	
2019/05/14	动力煤	620	ZC909	603	-0.69%	-17.00	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	595.2	-0.80%	-24.80	贴水扩大	
2019/05/14	PTA	6630	TA909	5560	-3.67%	-1070.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5284	-2.44%	-1346.00	升水缩窄	
2019/05/14	MA	2285	MA909	2374	-1.90%	89.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2438	-2.40%	153.00	升水缩窄	
2019/05/14	橡胶	11400	RU1910	11715	-2.25%	315.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	12510	-2.76%	1110.00	升水缩窄	
2019/05/14	豆油	5230	Y1909	5374	-0.11%	144.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5526	-0.07%	296.00	升水缩窄	
2019/05/14	豆粕	2740	M1909	2667	0.30%	-73.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2667	0.30%	-73.00	贴水缩窄	
2019/05/14	菜油	7250	O1909	7001	-0.07%	-249.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			O1001	6882	0.06%	-368.00	贴水扩大	
2019/05/14	菜粕	2260	RM909	2261	-0.26%	1.00	升水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2118	-0.24%	-142.00	贴水扩大	

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

2019/05/15		宏观基本面指标变化		
资金变动		隔夜	前一日	变化幅度
	两市融资余额（亿元）	9382.8000	9418.4000	-35.6000
	沪股通净流入（亿元）	-71.6221	-	-
	深股通净流入（亿元）	-37.3746	-	-
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.4552	2.2043	0.2509
	银行间质押式回购（7天）	2.5887	2.4401	0.1486
	Shibor（1天）	2.4123	2.1560	0.2563
	Shibor（7天）	2.6500	2.5790	0.0710
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.3200	2.1100	0.2100
	深市质押式回购	2.2900	2.3800	-0.0900
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，今日公布中国4月经济运行数据，北向资金净流出超百亿，两市成交处阶段性低位，A股震荡走低，避险情绪加剧，期指多单暂避。			
化工操作建议	沪胶维持震荡，09沪胶关注11600支撑，空单继续持有，注意止盈。			
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。