

2019年5月28日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货 投资咨询部		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	
2019/05/27	IF	3637.2	IF1906	3607.2	1.06%	-30.00	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3579	1.10%	-58.20	贴水扩大	
2019/05/27	IC	4962.9	IC1906	4903	2.73%	-59.95	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4841.8	2.79%	-121.15	贴水缩窄	
2019/05/27	IH	2722.3	IH1906	2702.6	0.88%	-19.73	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2680.2	0.84%	-42.13	贴水缩窄	
2019/05/27	TS	2.8838	TS1906	100.04	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	99.75	-0.14%	-	-	
2019/05/27	TF	3.1497	TF1906	99.02	-0.34%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	98.63	-0.33%	-	-	
2019/05/27	T	3.35	T1906	96.87	-0.45%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	96.3	-0.49%	-	-	
2019/05/24	铁矿	794.7	I1909	761	3.96%	-33.70	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	701.5	4.47%	-93.20	贴水缩窄	
2019/05/27	螺纹	4196	RB1910	3842	-1.21%	-353.88	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3555	-1.06%	-640.88	贴水扩大	
2019/05/27	LLDPE	7900	L1909	7765	0.06%	-135.00	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
			L2001	7700	0.13%	-200.00	贴水缩窄	
2019/05/27	PP	8400	PP1909	8193	-0.41%	-207.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	7934	-0.19%	-466.00	贴水缩窄	
2019/05/27	棕榈油	4210	P1909	4398	0.69%	188.00	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
			P2001	4572	0.40%	362.00	升水缩窄	
2019/05/27	焦煤	1710	JM1909	1388	-2.12%	-322.00	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	1357	-1.63%	-353.00	贴水扩大	
2019/05/27	焦炭	2349	J1909	2259	-2.67%	-90.46	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	2193	-1.97%	-156.46	贴水扩大	
2019/05/27	动力煤	615	ZC909	585.4	-0.71%	-29.60	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	580.8	-0.75%	-34.20	贴水扩大	
2019/05/27	PTA	5620	TA909	5436	2.45%	-184.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5230	1.20%	-390.00	升水扩大	
2019/05/27	MA	2350	MA909	2443	0.70%	93.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2488	0.28%	138.00	升水扩大	
2019/05/27	橡胶	11400	RU1910	11810	-0.17%	410.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	12780	0.00%	1380.00	升水扩大	
2019/05/27	豆油	5190	Y1909	5384	0.52%	194.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5534	0.40%	344.00	升水扩大	
2019/05/27	豆粕	2930	M1909	2827	2.06%	-103.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2827	2.06%	-103.00	贴水缩窄	
2019/05/27	菜油	7300	O1909	7086	1.01%	-214.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1001	7006	1.17%	-294.00	贴水缩窄	
2019/05/27	菜粕	2351	RM909	2460	1.78%	108.89	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2231	1.97%	-120.11	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

 东兴期货 投资咨询部 2019/5/28		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）	9236.3000	9281.6000	-45.3000
	沪股通净流入（亿元）	-11.1438	1.2501	-12.3939
	深股通净流入（亿元）	-7.9064	-17.4255	9.5191
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.7423	2.3772	0.3651
	银行间质押式回购（7天）	3.0578	2.5321	0.5257
	Shibor（1天）	2.6660	2.3420	0.3240
	Shibor（7天）	2.7110	2.5920	0.1190
二级市场流动性	沪市质押式回购	1.9050	2.6200	-0.7150
	深市质押式回购	0.0200	2.7060	-2.6860
期指操作建议	MSCI第一阶段A股扩容于今日盘后生效，上证综指收复5日均线，北向资金逆势净流出，市场情绪有所企稳，期指或轻仓试多。			
期债操作建议	同业流动性收紧，央行或采取措施，期债T09空单减仓持有，关注压制96.5。			
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。