



2019年5月30日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货 投资咨询部 DONGXING FUTURES		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	
2019/05/29	IF	3663.9	IF1906	3627.4	0.04%	-36.51	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3600	-0.03%	-63.91	贴水缩窄	
2019/05/29	IC	4956.9	IC1906	4866	-0.47%	-90.86	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4806.8	-0.43%	-150.06	贴水扩大	
2019/05/29	IH	2755.8	IH1906	2729.6	0.52%	-26.21	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2707.6	0.50%	-48.21	贴水缩窄	
2019/05/29	TS	2.8236	TS1906	100.155	0.05%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	99.93	0.09%	-	-	
2019/05/29	TF	3.0925	TF1906	99.36	0.21%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	98.975	0.23%	-	-	
2019/05/29	T	3.2875	T1906	97.47	0.34%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	96.87	0.34%	-	-	
2019/05/28	铁矿	823.76	I1909	748	-1.12%	-75.76	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	683.5	-1.80%	-140.26	贴水扩大	
2019/05/29	螺纹	4155	RB1910	3825	-0.52%	-329.64	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3553	-0.45%	-601.64	贴水缩窄	
2019/05/29	LLDPE	8000	L1909	7900	0.13%	-100.00	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
			L2001	7820	0.13%	-180.00	贴水扩大	
2019/05/29	PP	8450	PP1909	8354	0.88%	-96.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP料(T30S):余姚
			PP2001	8065	0.59%	-385.00	贴水扩大	
2019/05/29	棕榈油	4290	P1909	4510	2.45%	220.00	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	4634	1.85%	344.00	升水扩大	
2019/05/29	焦煤	1710	JM1909	1391.5	0.61%	-318.50	贴水缩窄	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM2001	1360.5	0.67%	-349.50	贴水缩窄	
2019/05/29	焦炭	2401	J1909	2222	-0.67%	-178.54	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	2182	0.41%	-218.54	贴水扩大	
2019/05/29	动力煤	609	ZC909	581	-0.82%	-28.00	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	578.4	-0.62%	-30.60	贴水扩大	
2019/05/29	PTA	5685	TA909	5452	0.07%	-233.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5244	0.19%	-441.00	升水缩窄	
2019/05/29	MA	2400	MA909	2494	2.00%	94.00	升水缩窄	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2539	1.85%	139.00	升水缩窄	
2019/05/29	橡胶	11800	RU1910	12255	2.42%	455.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	13195	2.09%	1395.00	升水扩大	
2019/05/29	豆油	5320	Y1909	5552	2.81%	232.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5704	2.81%	384.00	升水扩大	
2019/05/29	豆粕	3050	M1909	2954	3.03%	-96.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2954	3.03%	-96.00	贴水缩窄	
2019/05/29	菜油	7340	O1909	7145	1.18%	-195.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1001	7074	1.06%	-266.00	贴水缩窄	
2019/05/29	菜粕	2448	RM909	2592	4.60%	144.22	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2371	3.76%	-76.78	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 2019/5/30		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）	9265.9000	9286.0000	-20.1000
	沪股通净流入（亿元）	-27.7887	46.7724	-74.5611
	深股通净流入（亿元）	-4.7254	8.8962	-13.6216
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.5102	2.9069	-0.3967
	银行间质押式回购（7天）	3.0472	3.6250	-0.5778
	Shibor（1天）	2.4910	2.7600	-0.2690
	Shibor（7天）	2.7850	2.8230	-0.0380
二级市场流动性	沪市质押式回购	1.8750	1.2800	0.5950
	深市质押式回购	2.0400	1.3200	0.7200
期指操作建议	A股冲高回落，北向资金净流出，短期持续观望，期指多单暂避。			
化工操作建议	上游干旱因素维持，沪胶持续反弹，09沪胶震荡操作。			
农产品操作建议	原糖短期或已阶段性见底，中期仍以震荡为主，国内白糖进口利润打开，需继续关注进口情况，郑糖仍在熊市末期未走完，05空单继续持有。			
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。