



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年5月31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						
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:
2019/05/30	IF	3641.2	IF1906	3619.4	-0.22%	-21.78	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3593.2	-0.19%	-47.98	贴水缩窄	
2019/05/30	IC	4926.4	IC1906	4868.6	0.05%	-57.80	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4805	-0.04%	-121.40	贴水缩窄	
2019/05/30	IH	2743	IH1906	2723	-0.24%	-19.96	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2702.4	-0.19%	-40.56	贴水缩窄	
2019/05/30	TS	2.8073	TS1906	100.075	-0.08%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	99.9	-0.03%	-	-	
2019/05/30	TF	3.0682	TF1906	99.3	-0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	99	0.03%	-	-	
2019/05/30	T	3.275	T1906	97.505	0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	96.885	0.02%	-	-	
2019/05/29	铁矿	813.15	I1909	737	-1.47%	-76.15	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	674.5	-1.32%	-138.65	贴水扩大	
2019/05/30	螺纹	4155	RB1910	3777	-1.25%	-377.64	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3518	-0.99%	-636.64	贴水扩大	
2019/05/30	LLDPE	8000	L1909	7795	-1.33%	-205.00	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	7725	-1.21%	-275.00	贴水扩大	
2019/05/30	PP	8500	PP1909	8248	-1.27%	-252.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2001	7972	-1.15%	-528.00	贴水扩大	
2019/05/30	棕榈油	4290	P1909	4462	-1.06%	172.00	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	4598	-0.78%	308.00	升水缩窄	
2019/05/30	焦煤	1710	JM1909	1396.5	0.36%	-313.50	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	1365.5	0.37%	-344.50	贴水缩窄	
2019/05/30	焦炭	2401	J1909	2205	-0.77%	-195.54	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	2167.5	-0.66%	-233.04	贴水扩大	
2019/05/30	动力煤	608	ZC909	579.6	-0.24%	-28.40	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC001	579.8	0.24%	-28.20	贴水缩窄	
2019/05/30	PTA	5625	TA909	5398	-0.99%	-227.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5192	-0.99%	-433.00	升水缩窄	
2019/05/30	MA	2350	MA909	2439	-2.21%	89.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA001	2495	-1.73%	145.00	升水扩大	
2019/05/30	橡胶	11800	RU1910	12220	-0.29%	420.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	12995	-1.52%	1195.00	升水扩大	
2019/05/30	豆油	5320	Y1909	5476	-1.37%	156.00	升水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2001	5628	-1.33%	308.00	升水缩窄	
2019/05/30	豆粕	3050	M1909	2902	-1.76%	-148.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M1909	2902	-1.76%	-148.00	贴水扩大	
2019/05/30	菜油	7340	O1909	7086	-0.83%	-254.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			O1001	7020	-0.76%	-320.00	贴水扩大	
2019/05/30	菜粕	2451	RM909	2510	-3.16%	59.44	升水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM001	2326	-1.90%	-124.56	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

 东兴期货 DONGXING FUTURES 投资咨询部 2019/5/31		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）	9269.7000	9265.9000	3.8000
	沪股通净流入（亿元）	0.5946	-27.7887	28.3833
	深股通净流入（亿元）	-8.4773	-4.7254	-3.7519
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.0813	2.5102	-0.4289
	银行间质押式回购（7天）	2.7490	3.0472	-0.2982
	Shibor（1天）	2.0670	2.4910	-0.4240
	Shibor（7天）	2.6650	2.7850	-0.1200
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.4700	1.8750	0.5950
	深市质押式回购	2.5500	2.0400	0.5100
期指操作建议	短期震荡趋势不变，期指多单暂避，关注中美贸易最新动态。			
化工操作建议	原油延续弱势，需求旺季仍未开启，12沥青关注3000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。