



2019年6月11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	
2019/06/10	IF	3610.7	IF1906	3591.8	1.33%	-18.94	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3564	1.35%	-46.74	贴水缩窄	
2019/06/10	IC	4725.3	IC1906	4658	1.00%	-67.26	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4593	0.90%	-132.26	贴水扩大	
2019/06/10	IH	2743.4	IH1906	2724	1.27%	-19.37	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2701.8	1.29%	-41.57	贴水扩大	
2019/06/10	TS	2.7927	TS1906	100.31	0.05%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	100.06	0.01%	-	-	
2019/06/10	TF	3.0765	TF1906	99.62	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	99.26	-0.03%	-	-	
2019/06/10	T	3.2251	T1906	98.08	0.08%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	97.41	-0.06%	-	-	
2019/06/06	铁矿	794.12	I1909	729.5	2.39%	-64.62	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	654	1.55%	-140.12	贴水扩大	
2019/06/10	螺纹	4041	RB1910	3717	-0.54%	-324.24	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3457	-0.80%	-584.24	贴水缩窄	
2019/06/10	LLDPE	7700	L1909	7565	-0.26%	-135.00	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	7485	-0.07%	-215.00	贴水扩大	
2019/06/10	PP	8280	PP1909	8038	0.25%	-242.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	7667	0.54%	-613.00	贴水扩大	
2019/06/10	棕榈油	4260	P1909	4398	0.18%	138.00	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	4556	0.13%	296.00	升水缩窄	
2019/06/10	焦煤	1710	JM1909	1415	1.91%	-295.00	贴水缩窄	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM2001	1369	1.41%	-341.00	贴水缩窄	
2019/06/10	焦炭	2401	J1909	2126.5	-0.93%	-274.04	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	2065	-1.22%	-335.54	贴水扩大	
2019/06/10	动力煤	595	ZC909	587	0.86%	-8.00	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	580.4	0.31%	-14.60	贴水缩窄	
2019/06/10	PTA	5610	TA909	5320	3.22%	-290.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5072	2.22%	-538.00	升水缩窄	
2019/06/10	MA	2270	MA909	2319	1.09%	49.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2374	1.11%	104.00	升水缩窄	
2019/06/10	橡胶	12000	RU1910	12365	-0.12%	365.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	13235	0.49%	1235.00	升水扩大	
2019/06/10	豆油	5190	Y1909	5460	0.37%	270.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5608	0.36%	418.00	升水扩大	
2019/06/10	豆粕	2980	M1909	2864	-0.35%	-116.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2864	-0.35%	-116.00	贴水缩窄	
2019/06/10	菜油	7310	O1909	7082	-0.10%	-228.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			O1001	7015	0.07%	-295.00	贴水缩窄	
2019/06/10	菜粕	2446	RM909	2468	-0.40%	21.89	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2306	0.00%	-140.11	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

 <b>东兴期货</b> 投资咨询部      2019/6/11		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）	9089.7000	9149.8000	-60.1000
	沪股通净流入（亿元）	49.5798	15.0024	34.5774
	深股通净流入（亿元）	29.3929	-4.2168	33.6097
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.9021	1.5751	0.3270
	银行间质押式回购（7天）	2.5166	2.4397	0.0769
	Shibor（1天）	1.8480	1.5210	0.3270
	Shibor（7天）	2.6040	2.5720	0.0320
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.3550	2.3600	-0.0050
	深市质押式回购	2.2930	2.1000	0.1930
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，北向资金持续净流入，但两市成交持续低迷，震荡趋势不变，期指多单暂避。			
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。