

2019年6月13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	
2019/06/12	IF	3691.1	IF1906	3676	-0.81%	-15.10	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3650.2	-0.89%	-40.90	贴水扩大	
2019/06/12	IC	4863.5	IC1906	4816.4	-1.23%	-47.09	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4753	-1.27%	-110.49	贴水扩大	
2019/06/12	IH	2796.7	IH1906	2787.6	-0.29%	-9.13	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2765	-0.33%	-31.73	贴水缩窄	
2019/06/12	TS	2.9198	TS1906	100.185	-0.12%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	100.03	0.02%	-	-	
2019/06/12	TF	3.1132	TF1906	99.4	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	99.125	0.04%	-	-	
2019/06/12	T	3.2601	T1906	97.81	0.07%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	97.13	0.04%	-	-	
2019/06/11	铁矿	830.09	I1909	764	0.46%	-66.09	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	684	-0.07%	-146.09	贴水缩窄	
2019/06/12	螺纹	4082	RB1910	3776	-1.49%	-306.47	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3516	-1.24%	-566.47	贴水扩大	
2019/06/12	LLDPE	7750	L1909	7510	-1.25%	-240.00	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	7430	-1.20%	-320.00	贴水扩大	
2019/06/12	PP	8300	PP1909	7951	-1.38%	-349.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP料(T30S):余姚
			PP2001	7601	-1.16%	-699.00	贴水扩大	
2019/06/12	棕榈油	4230	P1909	4344	-1.18%	114.00	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	4520	-0.88%	290.00	升水缩窄	
2019/06/12	焦煤	1710	JM1909	1399	-2.64%	-311.00	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	1358	-1.77%	-352.00	贴水扩大	
2019/06/12	焦炭	2401	J1909	2114.5	-4.26%	-286.04	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	2062	-3.67%	-338.54	贴水扩大	
2019/06/12	动力煤	595	ZC909	593.6	-0.03%	-1.40	贴水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	583.2	-0.17%	-11.80	贴水扩大	
2019/06/12	PTA	5505	TA909	5158	-2.57%	-347.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	4976	-1.54%	-529.00	升水缩窄	
2019/06/12	MA	2265	MA909	2296	-1.54%	31.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2351	-1.55%	86.00	升水缩窄	
2019/06/12	橡胶	11900	RU1910	12420	0.00%	520.00	升水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	13120	-2.09%	1220.00	升水扩大	
2019/06/12	豆油	5150	Y1909	5408	-1.06%	258.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5562	-1.00%	412.00	升水缩窄	
2019/06/12	豆粕	2980	M1909	2863	-0.17%	-117.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2863	-0.17%	-117.00	贴水缩窄	
2019/06/12	菜油	7240	O1909	7060	-0.42%	-180.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1001	7009	-0.20%	-231.00	贴水缩窄	
2019/06/12	菜粕	2447	RM909	2460	-0.24%	13.33	升水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2292	-0.69%	-154.67	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 投资咨询部 2019/6/13		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）	9112.7000	9089.8000	22.9000
	沪股通净流入（亿元）	14.6734	37.7459	-23.0725
	深股通净流入（亿元）	-1.8133	31.7137	-33.5270
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.9895	2.1013	-0.1118
	银行间质押式回购（7天）	2.5763	2.5609	0.0154
	Shibor（1天）	1.9390	2.0530	-0.1140
	Shibor（7天）	2.5640	2.5890	-0.0250
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.1200	2.3100	-0.1900
	深市质押式回购	1.8000	1.7500	0.0500
期指操作建议	本周期指交割，注意移仓，北向资金连续7日净流入，A股弱势整理，短期行情受事件驱动，无明显趋势性行情，建议期指多单暂避。			
期债操作建议	供给压力增加，期债T09中线多单暂避。			
农产品操作建议	美国未来十五日降雨量显著增大，美豆种植面积或将低于预期，粕类或将有所反弹。			
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投资咨询部所有。未获得东兴期货投资咨询部书面授权，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“东兴期货投资咨询部”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。