



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年6月14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:
2019/06/13	IF	3685.4	IF1906	3668.6	-0.20%	-16.79	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3639.8	-0.28%	-45.59	贴水扩大	
2019/06/13	IC	4877.7	IC1906	4838.6	0.46%	-39.05	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4766.2	0.28%	-111.45	贴水扩大	
2019/06/13	IH	2794.5	IH1906	2783.8	-0.14%	-10.74	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2760.4	-0.17%	-34.14	贴水扩大	
2019/06/13	TS	2.9207	TS1906	100.185	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	100.035	0.00%	-	-	
2019/06/13	TF	3.098	TF1906	99.395	-0.01%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	99.255	0.13%	-	-	
2019/06/13	T	3.2451	T1906	97.91	0.10%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	97.34	0.22%	-	-	
2019/06/12	铁矿	842.45	I1909	781.5	2.29%	-60.95	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	702	2.63%	-140.45	贴水扩大	
2019/06/13	螺纹	4041	RB1910	3792	0.42%	-249.24	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3526	0.28%	-515.24	贴水缩窄	
2019/06/13	LLDPE	7700	L1909	7585	1.00%	-115.00	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	7485	0.74%	-215.00	贴水缩窄	
2019/06/13	PP	8330	PP1909	8045	1.18%	-285.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2001	7667	0.87%	-663.00	贴水缩窄	
2019/06/13	棕榈油	4240	P1909	4370	0.60%	130.00	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	4550	0.66%	310.00	升水扩大	
2019/06/13	焦煤	1710	JM1909	1405	0.43%	-305.00	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	1365	0.52%	-345.00	贴水缩窄	
2019/06/13	焦炭	2401	J1909	2151.5	1.75%	-249.04	贴水缩窄	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	2100	1.84%	-300.54	贴水缩窄	
2019/06/13	动力煤	595	ZC909	589.2	-0.74%	-5.80	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC001	582.4	-0.14%	-12.60	贴水扩大	
2019/06/13	PTA	5495	TA909	5224	1.28%	-271.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	4994	0.36%	-501.00	升水缩窄	
2019/06/13	MA	2315	MA909	2358	2.70%	43.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA001	2403	2.21%	88.00	升水扩大	
2019/06/13	橡胶	11900	RU1910	12420	0.00%	520.00	贴水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	13225	0.80%	1325.00	升水扩大	
2019/06/13	豆油	5150	Y1909	5460	0.96%	310.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2001	5612	0.90%	462.00	升水扩大	
2019/06/13	豆粕	3050	M1909	2917	1.89%	-133.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M1909	2917	1.89%	-133.00	贴水扩大	
2019/06/13	菜油	7240	O1909	7105	0.64%	-135.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			O1001	7044	0.50%	-196.00	贴水缩窄	
2019/06/13	菜粕	2479	RM909	2523	2.56%	43.56	升水扩大	现货价: 平均价: 菜粕
			RM001	2334	1.83%	-145.44	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 DONGXING FUTURES 投资咨询部2019/6/14		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）	9127.0000	9112.7000	14.3000
	沪股通净流入（亿元）	12.2634	14.6734	-2.4100
	深股通净流入（亿元）	-0.5530	-1.8133	1.2603
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.9730	1.9895	-0.0165
	银行间质押式回购（7天）	2.5704	2.5763	-0.0059
	Shibor（1天）	1.9240	1.9390	-0.0150
	Shibor（7天）	2.5830	2.5640	0.0190
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.1500	2.1200	0.0300
	深市质押式回购	2.0000	1.8000	0.2000
期指操作建议	今日期指交割，注意移仓，下午公布5月经济运行数据，北向资金继续净流入，A股缩量盘整，期指多单暂避。			
期债操作建议	利率债窄幅波动，期债T09中线多单可暂避。			
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。