



2019年6月17日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货 投资咨询部		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	
2019/06/14	IF	3654.9	IF1906	3645	-0.64%	-9.88	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3615.6	-0.66%	-39.28	贴水缩窄	
2019/06/14	IC	4795.5	IC1906	4769.2	-1.43%	-26.33	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4682	-1.77%	-113.53	贴水扩大	
2019/06/14	IH	2785.6	IH1906	2775.2	-0.31%	-10.41	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2752	-0.30%	-33.61	贴水缩窄	
2019/06/14	TS	2.9066	TS1906	100.185	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1909	100.1	0.06%	-	-	
2019/06/14	TF	3.0732	TF1906	99.395	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1909	99.39	0.14%	-	-	
2019/06/14	T	3.2302	T1906	97.91	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1909	97.575	0.24%	-	-	
2019/06/13	铁矿	846.98	I1909	783.5	0.26%	-63.48	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	702.5	0.07%	-144.48	贴水缩窄	
2019/06/14	螺纹	4041	RB1910	3755	-0.98%	-286.24	贴水扩大	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3510	-0.45%	-531.24	贴水扩大	
2019/06/14	LLDPE	7700	L1909	7525	-0.79%	-175.00	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	7450	-0.47%	-250.00	贴水扩大	
2019/06/14	PP	8350	PP1909	8000	-0.56%	-350.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	7638	-0.38%	-712.00	贴水扩大	
2019/06/14	棕榈油	4250	P1909	4388	0.41%	138.00	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	4574	0.53%	324.00	升水扩大	
2019/06/14	焦煤	1710	JM1909	1386	-1.35%	-324.00	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	1350	-1.10%	-360.00	贴水扩大	
2019/06/14	焦炭	2401	J1909	2108.5	-2.00%	-292.04	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	2066	-1.62%	-334.54	贴水扩大	
2019/06/14	动力煤	594	ZC909	589.2	0.00%	-4.80	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	582	-0.07%	-12.00	贴水缩窄	
2019/06/14	PTA	5580	TA909	5234	0.19%	-346.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	4984	-0.20%	-596.00	升水扩大	
2019/06/14	MA	2300	MA909	2339	-0.81%	39.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2383	-0.83%	83.00	升水缩窄	
2019/06/14	橡胶	11800	RU1910	12160	-2.09%	360.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	12925	-2.27%	1125.00	升水缩窄	
2019/06/14	豆油	5180	Y1909	5474	0.26%	294.00	升水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5628	0.29%	448.00	升水缩窄	
2019/06/14	豆粕	3050	M1909	2909	-0.27%	-141.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1909	2909	-0.27%	-141.00	贴水扩大	
2019/06/14	菜油	7240	O1909	7092	-0.18%	-148.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			O1001	7036	-0.11%	-204.00	贴水扩大	
2019/06/14	菜粕	2479	RM909	2523	0.00%	44.11	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2331	-0.13%	-147.89	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 2019/6/17		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）	9145.2000	9127.0000	18.2000
	沪股通净流入（亿元）	-0.3017	12.2634	-12.5651
	深股通净流入（亿元）	-16.0804	-0.5530	-15.5274
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.7673	1.9730	-0.2057
	银行间质押式回购（7天）	2.5051	2.5704	-0.0653
	Shibor（1天）	1.7230	1.9240	-0.2010
	Shibor（7天）	2.5650	2.5830	-0.0180
二级市场流动性	沪市质押式回购	1.8050	2.1500	-0.3450
	深市质押式回购	0.4440	2.0000	-1.5560
期指操作建议	北向资金净流出，A股震荡下行，流动性结构性问题与中美贸易不确定性暂存，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。			
化工操作建议	国储局轮储方案暂时延期讨论，09沪胶关注11700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。