

2019年6月18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						
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:
2019/06/17	IF	3654.8	IF1906	3652	0.19%	-2.82	贴水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3621.8	0.17%	-33.02	贴水缩窄	
2019/06/17	IC	4802.8	IC1906	4792.8	0.49%	-10.02	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4699	0.36%	-103.82	贴水缩窄	
2019/06/17	IH	2793.7	IH1906	2787.4	0.44%	-6.30	贴水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2762	0.36%	-31.70	贴水缩窄	
2019/06/17	TS	2.8904	TS1909	100.105	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	99.9	0.04%	-	-	
2019/06/17	TF	3.0562	TF1909	99.415	0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.14	0.06%	-	-	
2019/06/17	T	3.2252	T1909	97.665	0.09%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	97.2	0.12%	-	-	
2019/06/17	铁矿	851.16	I1909	768.5	-1.91%	-82.66	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	684	-2.63%	-167.16	贴水扩大	
2019/06/17	螺纹	3979	RB1910	3704	-1.36%	-275.38	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3462	-1.37%	-517.38	贴水缩窄	
2019/06/17	LLDPE	7700	L1909	7510	-0.20%	-190.00	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	7425	-0.34%	-275.00	贴水扩大	
2019/06/17	PP	8350	PP1909	8015	0.19%	-335.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2001	7663	0.33%	-687.00	贴水缩窄	
2019/06/17	棕榈油	4240	P1909	4372	-0.36%	132.00	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	4578	0.09%	338.00	升水扩大	
2019/06/17	焦煤	1710	JM1909	1383.5	-0.18%	-326.50	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	1343.5	-0.48%	-366.50	贴水扩大	
2019/06/17	焦炭	2401	J1909	2064.5	-2.09%	-336.04	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	2030	-1.74%	-370.54	贴水扩大	
2019/06/17	动力煤	594	ZC909	591.2	0.34%	-2.80	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC001	582.8	0.14%	-11.20	贴水缩窄	
2019/06/17	PTA	5630	TA909	5318	1.60%	-312.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5034	1.00%	-596.00	升水扩大	
2019/06/17	MA	2305	MA909	2341	0.09%	36.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA001	2387	0.17%	82.00	升水缩窄	
2019/06/17	橡胶	11600	RU1910	11815	-2.84%	215.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2001	12755	-1.32%	1155.00	升水扩大	
2019/06/17	豆油	5180	Y1909	5514	0.73%	334.00	升水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y2001	5676	0.85%	496.00	升水扩大	
2019/06/17	豆粕	3050	M1909	2973	2.20%	-77.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M1909	2973	2.20%	-77.00	贴水缩窄	
2019/06/17	菜油	7240	O1909	7092	0.00%	-148.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽
			O1001	7068	0.45%	-172.00	贴水缩窄	
2019/06/17	菜粕	2483	RM909	2565	1.66%	82.22	升水扩大	现货价:平均价:菜粕
			RM001	2367	1.54%	-115.78	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 投资咨询部 2019/6/18		宏观基本面指标变化		
		隔夜	前一日	变化幅度
资金变动	两市融资余额（亿元）	9096.5000	9145.2000	-48.7000
	沪股通净流入（亿元）	5.4110	-0.3017	5.7127
	深股通净流入（亿元）	-0.3379	-16.0804	15.7425
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.8478	1.7673	0.0805
	银行间质押式回购（7天）	2.5190	2.5051	0.0139
	Shibor（1天）	1.8010	1.7230	0.0780
	Shibor（7天）	2.4910	2.5650	-0.0740
二级市场流动性	沪市质押式回购	1.3700	1.8050	-0.4350
	深市质押式回购	0.7000	0.4440	0.2560
期指操作建议	北向资金净流入，两市成交量创4个月新低，期指多单暂避。			
化工操作建议	5月越南橡胶出口总量为7.75万吨，环比上涨2.7%，同比减少28.80%，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。