



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年6月19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:
2019/06/18	IF	3667.6	IF1906	3661.2	0.25%	-6.42	贴水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1907	3633.4	0.32%	-34.22	贴水扩大	
2019/06/18	IC	4797.1	IC1906	4790.8	-0.04%	-6.35	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC1907	4705	0.13%	-92.15	贴水缩窄	
2019/06/18	IH	2806.5	IH1906	2798.4	0.39%	-8.05	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1907	2774	0.43%	-32.45	贴水扩大	
2019/06/18	TS	2.8792	TS1909	100.075	-0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1912	99.89	-0.01%	-	-	
2019/06/18	TF	3.0542	TF1909	99.355	-0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1912	99.09	-0.05%	-	-	
2019/06/18	T	3.2302	T1909	97.49	-0.18%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1912	97.05	-0.15%	-	-	
2019/06/17	铁矿	851.16	I1909	786	2.28%	-65.16	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2001	695.5	1.68%	-155.66	贴水扩大	
2019/06/18	螺纹	3969	RB1910	3732	0.76%	-237.07	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3498	1.04%	-471.07	贴水缩窄	
2019/06/18	LLDPE	7700	L1909	7560	0.67%	-140.00	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	7460	0.47%	-240.00	贴水缩窄	
2019/06/18	PP	8300	PP1909	8058	0.54%	-242.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2001	7693	0.39%	-607.00	贴水缩窄	
2019/06/18	棕榈油	4250	P1909	4376	0.09%	126.00	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	4568	-0.22%	318.00	升水缩窄	
2019/06/18	焦煤	1710	JM1909	1389	0.40%	-321.00	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	1344	0.04%	-366.00	贴水缩窄	
2019/06/18	焦炭	2298	J1909	2055.5	-0.44%	-242.89	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	2024	-0.30%	-274.39	贴水缩窄	
2019/06/18	动力煤	594	ZC909	597.6	1.08%	3.60	升水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC001	588	0.89%	-6.00	贴水缩窄	
2019/06/18	PTA	5675	TA909	5416	1.84%	-259.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA001	5056	0.44%	-619.00	升水扩大	
2019/06/18	MA	2310	MA909	2356	0.64%	46.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA001	2399	0.50%	89.00	升水扩大	
2019/06/18	橡胶	11500	RU1910	11880	0.55%	380.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	12855	0.78%	1355.00	升水扩大	
2019/06/18	豆油	5180	Y1909	5506	-0.15%	326.00	升水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2001	5662	-0.25%	482.00	升水缩窄	
2019/06/18	豆粕	3050	M1909	2939	-1.14%	-111.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M1909	2939	-1.14%	-111.00	贴水扩大	
2019/06/18	菜油	7240	O1909	7087	-0.07%	-153.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			O1001	7082	0.20%	-158.00	贴水缩窄	
2019/06/18	菜粕	2479	RM909	2526	-1.52%	46.56	升水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM001	2345	-0.93%	-134.44	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 DONGXING FUTURES 投资咨询部2019/6/19		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）	9099.1000	9096.5000	2.6000
	沪股通净流入（亿元）	9.7492	5.4110	4.3382
	深股通净流入（亿元）	6.1724	-0.3379	6.5103
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.6536	1.8478	-0.1942
	银行间质押式回购（7天）	2.4097	2.5190	-0.1093
	Shibor（1天）	1.6010	1.8010	-0.2000
	Shibor（7天）	2.3990	2.4910	-0.0920
二级市场流动性	沪市质押式回购	1.5550	1.3700	0.1850
	深市质押式回购	1.7000	0.7000	1.0000
期指操作建议	昨日习特通话改善市场情绪，月末或有阶段性布局机会，期指低位轻仓试多			
期债操作建议	公开市场小幅投放，隔夜小幅缓解，期债T09前多谨持。			
化工操作建议	短期内沪胶依然维持震荡思路，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。