



2018年12月28日

研发中心

一、隔夜基差表

东兴期货		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	
2018/12/27	IF	2990.5	IF1901	2995.8	-0.31%	5.29	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1902	2996.8	-0.25%	6.29	升水扩大	
2018/12/27	IC	4161.3	IC1901	4131	-1.38%	-30.27	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1902	4110.8	-1.19%	-50.47	贴水扩大	
2018/12/27	IH	2276.1	IH1901	2287.6	0.13%	11.54	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1902	2291.2	0.03%	15.14	升水扩大	
2018/12/27	TS	2.7655	TS1903	100.17	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS1906	100.095	0.00%	-	-	
2018/12/27	TF	3.001	TF1903	99.145	-0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF1906	99.04	-0.10%	-	-	
2018/12/27	T	3.2709	T1903	97.31	0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T1906	97.29	0.04%	-	-	
2018/12/27	铁矿	593.07	I1901	540	0.28%	-53.07	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I1905	491.5	-0.20%	-101.57	贴水扩大	
2018/12/27	螺纹	3928	RB1901	3886	0.80%	-41.84	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB1905	3396	-0.38%	-531.84	贴水扩大	
2018/12/27	LLDPE	9200	L1901	9055	0.50%	-145.00	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
			L1905	8570	1.00%	-630.00	贴水缩窄	
2018/12/27	PP	9150	PP1901	9110	0.26%	-40.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S):余姚
			PP1905	8540	1.20%	-610.00	贴水缩窄	
2018/12/27	棕榈油	4090	P1901	4076	0.54%	-14.00	贴水缩窄	交货价: 棕榈油:天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P1905	4504	0.13%	414.00	升水扩大	
2018/12/27	焦煤	1710	JM1901	1451	1.33%	-259.00	贴水缩窄	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM1905	1172	0.04%	-538.00	贴水缩窄	
2018/12/27	焦炭	2452	J1901	2387.5	1.12%	-64.11	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
			J1905	1889	-0.18%	-562.61	贴水扩大	
2018/12/27	动力煤	570	ZC901	583.2	0.07%	13.20	升水扩大	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC905	559.8	1.19%	-10.20	贴水缩窄	
2018/12/27	PTA	6135	TA901	6020	-0.40%	-115.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA905	5762	-0.03%	-373.00	升水缩窄	
2018/12/27	MA	2300	MA901	2307	0.30%	7.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇:江苏出罐
			MA905	2382	1.53%	82.00	升水扩大	
2018/12/27	橡胶	10550	RU1901	10965	1.53%	415.00	贴水扩大	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU1905	11255	1.95%	705.00	贴水扩大	
2018/12/27	豆油	5150	Y1901	4916	-0.16%	-234.00	贴水扩大	现货价:四级豆油:大连
			Y1905	5388	-0.41%	238.00	升水缩窄	
2018/12/27	豆粕	2960	M1901	2770	-1.42%	-190.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连
			M1905	2625	-0.34%	-335.00	贴水扩大	
2018/12/27	菜油	6440	O1901	6293	-0.21%	-147.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			O1905	6436	-0.37%	-4.00	贴水缩窄	
2018/12/27	菜粕	2239	RM901	2053	-0.73%	-185.89	贴水扩大	现货价:均价:菜粕
			RM905	2102	-0.28%	-136.89	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

2018/12/28		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）	7629.8000	7635.9000	-6.1000
	沪股通净流入（亿元）	10.3102	0.0000	10.3102
	深股通净流入（亿元）	-4.9743	0.0000	-4.9743
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.8112	2.0452	-0.2340
	银行间质押式回购（7天）	5.9222	4.8384	1.0838
	Shibor（1天）	1.7930	2.0290	-0.2360
	Shibor（7天）	2.6950	2.6720	0.0230
二级市场流动性	沪市质押式回购	7.7850	5.5050	2.2800
	深市质押式回购	2.0000	5.5000	-3.5000
期指操作建议	沪深两市高开低走，两市成交2638亿元，北上资金逆势净流入逾5亿元，道指盘中一度跌破600点，最终收涨260点，波动显著，谨慎者期指IF01多单暂避，关注沪深300指数3000点争夺。			
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研发中心所有。未获得东兴期货研发中心书面授权，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“东兴期货研发中心”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。