



2019年12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:
2019/12/17	IF	4041.8	IF1912	4048.2	1.51%	6.40	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF2001	4056.8	1.72%	15.00	升水扩大	
2019/12/17	IC	5236.1	IC1912	5245	1.56%	8.94	升水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC2001	5232	1.74%	-4.06	贴水缩窄	
2019/12/17	IH	3033.1	IH1912	3037	1.25%	3.86	升水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH2001	3036.4	1.23%	3.26	升水扩大	
2019/12/17	TS	2.7004	TS2003	100.175	-0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2006	100	-0.05%	-	-	
2019/12/17	TF	3.0105	TF2003	99.5	-0.14%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2006	99.235	-0.13%	-	-	
2019/12/17	T	3.2133	T2003	97.53	-0.24%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2006	97.21	-0.21%	-	-	
2019/12/16	铁矿	739.15	I2001	674	-1.03%	-65.15	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	634.5	-1.70%	-104.65	贴水扩大	
2019/12/17	螺纹	3979	RB2001	3687	-0.27%	-292.38	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2005	3484	0.11%	-495.38	贴水缩窄	
2019/12/17	LLDPE	7300	L2001	7245	-0.55%	-55.00	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
			L2005	7275	-0.21%	-25.00	贴水扩大	
2019/12/17	PP	7980	PP2001	7790	-0.47%	-190.00	贴水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7525	-1.00%	-455.00	贴水扩大	
2019/12/17	棕榈油	6080	P2001	6032	0.94%	-48.00	贴水扩大	交货价: 棕榈油: 天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P2005	5968	0.64%	-112.00	贴水扩大	
2019/12/17	焦煤	1610	JM2001	1244.5	0.00%	-365.50	贴水扩大	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产
			JM2005	1168	-0.09%	-442.00	贴水扩大	
2019/12/17	焦炭	2145	J2001	1942	0.83%	-203.16	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
			J2005	1854.5	1.59%	-290.66	贴水缩窄	
2019/12/17	动力煤	548	ZC001	549	-0.25%	1.50	升水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	542	-0.37%	-5.50	贴水扩大	
2019/12/17	PTA	4890	TA001	4880	-0.45%	-10.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	4956	-0.44%	66.00	升水缩窄	
2019/12/17	MA	2020	MA001	2030	0.94%	10.00	升水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2157	1.51%	137.00	升水扩大	
2019/12/17	橡胶	12250	RU2001	12925	1.29%	675.00	升水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2005	13265	1.34%	1015.00	升水扩大	
2019/12/17	豆油	6750	Y2001	6608	1.47%	-142.00	贴水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6586	1.67%	-164.00	贴水扩大	
2019/12/17	豆粕	2960	M2001	2759	-0.72%	-201.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M2005	2759	-0.72%	-201.00	贴水扩大	
2019/12/17	菜油	8040	OI001	7618	0.55%	-422.00	贴水扩大	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7414	0.79%	-626.00	贴水扩大	
2019/12/17	菜粕	2304	RM001	2219	-0.18%	-85.44	贴水缩窄	现货价: 均价: 菜粕
			RM005	2290	0.13%	-14.44	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 投资咨询部 2019/12/18		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）	9907.0200	9813.0700	93.9500
	沪股通净流入（亿元）	49.9027	-3.7349	53.6376
	深股通净流入（亿元）	38.1626	10.7350	27.4276
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.5698	2.4885	0.0813
	银行间质押式回购（7天）	2.7138	2.6140	0.0998
	Shibor（1天）	2.5060	2.4370	0.0690
	Shibor（7天）	2.5880	2.5315	0.0565
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.7550	2.9600	-0.2050
	深市质押式回购	1.9000	3.1000	-1.2000
期指操作建议	上证指数收复3000点，两市成交续创三个月新高，北向资金连续24日净流入，期指多单续持。			
化工操作建议	有消息称轮胎厂或向上调价，沪胶维持偏强震荡。EG现货仍偏紧，警惕逼仓风险，EG 供需转入累库预期仍未实现。			
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。