

2019年12月26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							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		
2019/12/25	IF	3990.9	IF2001	4002.8	0.11%	11.93	升水扩大	现货价格: 沪深300指数	
			IF2002	4009	0.12%	18.13	升水扩大		
2019/12/25	IC	5183.1	IC2001	5167.8	0.48%	-15.30	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数	
			IC2002	5153.2	0.64%	-29.90	贴水缩窄		
2019/12/25	IH	2986	IH2001	2996.8	-0.21%	10.80	升水扩大	现货价格: 上证50指数	
			IH2002	2997.6	-0.19%	11.60	升水扩大		
2019/12/25	TS	2.531	TS2003	100.38	0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)	
			TS2006	100.2	0.03%	-	-		
2019/12/25	TF	2.9236	TF2003	99.915	0.07%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)	
			TF2006	99.625	0.06%	-	-		
2019/12/25	T	3.1463	T2003	98.13	0.09%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)	
			T2006	97.735	0.07%	-	-		
2019/12/24	铁矿	725.49	I2001	677	-0.44%	-48.49	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价	
			I2005	638.5	-0.62%	-86.99	贴水缩窄		
2019/12/25	螺纹	3856	RB2001	3695	-0.81%	-160.67	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格	
			RB2005	3485	-0.71%	-370.67	贴水缩窄		
2019/12/25	LLDPE	7250	L2001	7235	0.42%	-15.00	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	
			L2005	7350	0.68%	100.00	升水扩大		
2019/12/25	PP	7800	PP2001	7658	-0.23%	-142.00	贴水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚	
			PP2005	7518	0.29%	-282.00	贴水缩窄		
2019/12/25	棕榈油	6220	P2001	6224	-0.06%	4.00	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	
			P2005	6052	0.07%	-168.00	贴水缩窄		
2019/12/25	焦煤	1610	JM2001	1203	0.21%	-407.00	贴水缩窄	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产	
			JM2005	1151.5	0.09%	-458.50	贴水缩窄		
2019/12/25	焦炭	2145	J2001	1915	-0.36%	-230.16	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	
			J2005	1846	-0.43%	-299.16	贴水扩大		
2019/12/25	动力煤	549	ZC001	549.2	0.15%	0.70	升水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛	
			ZC005	552.2	-0.32%	3.70	升水缩窄		
2019/12/25	PTA	4850	TA001	4886	-0.04%	36.00	升水缩窄	PTA:CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘	
			TA005	4960	-0.12%	110.00	升水缩窄		
2019/12/25	MA	2050	MA001	2084	1.96%	34.00	升水扩大	MA:市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐	
			MA005	2164	0.93%	114.00	升水扩大		
2019/12/25	橡胶	11950	RU2001	12500	0.04%	550.00	贴水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海	
			RU2005	12820	0.08%	870.00	升水扩大		
2019/12/25	豆油	6660	Y2001	6508	-0.12%	-152.00	贴水扩大	现货价:四级豆油:大连	
			Y2005	6568	-0.12%	-92.00	贴水扩大		
2019/12/25	豆粕	2890	M2001	2705	-0.73%	-185.00	贴水扩大	现货价:豆粕:大连	
			M2005	2742	-0.36%	-148.00	贴水扩大		
2019/12/25	菜油	8000	OI001	7763	-0.09%	-237.00	贴水扩大	现货价:菜油:安徽	
			OI005	7566	-0.15%	-434.00	贴水扩大		
2019/12/25	菜粕	2304	RM001	2192	-0.18%	-111.89	贴水扩大	现货价:平均价:菜粕	
			RM005	2276	0.18%	-27.89	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		2019/12/26		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）	10097.7629	10096.6600	1.1029	
	沪股通净流入（亿元）	0.0000	0.0000	0.0000	
	深股通净流入（亿元）	0.0000	0.0000	0.0000	
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.0581	1.1966	-0.1385	
	银行间质押式回购（7天）	2.7481	1.9888	0.7593	
	Shibor（1天）	0.9430	1.1140	-0.1710	
	Shibor（7天）	2.5490	2.4500	0.0990	
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.5800	2.5600	0.0200	
	深市质押式回购	2.4500	2.0660	0.3840	
化工品操作建议	明年基建等需求存在预期，沪胶或轻仓多单入场。				
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。