

期货晨报

期货研究报告

2019年12月26日

投资咨询部

一、隔夜基差表

T2005 638.5 -0.62% -86.99 贴水缩窄	东兴期货 投资咨询部		隔夜基差表								
1	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:		
1	2019/12/25	IF	3990. 9	IF2001	4002.8	0.11%	11.93	升水扩大	现化公拉 流流200世粉		
1				IF2002	4009	0.12%	18.13	升水扩大			
1	2019/12/25	IC	5183.1	IC2001	5167.8	0.48%	-15.30	贴水缩窄	现化价权 由江西00七米		
11				IC2002	5153.2	0.64%	-29.90		况贝尔伯: 中世500 ₁ 日奴		
182002 100.38 10.0.48 現货:中债到期收益率(2年)	2019/12/25	IH	2986	IH2001	2996.8	-0.21%	10.80		和华伦林、上证50华新		
TS 2.5 TS 2.5 TS 2.5 TS 2.5 TS TS TS TS TS TS TS T				IH2002	2997.6	-0.19%	11.60	升水扩大	况页[[1] 工业OV报数		
182006 99.625 0.07% 現货、中债到期收益率 (5年)	2019/12/25	TS	2. 531				П		现货:中债到期收益率(2年)		
TF 2.9236 TF 2.9236 TF2006 99.625 0.06% - -	2019/12/20						_	-			
TP2006 99.625 0.66% - -	2019/12/25	TF	2.9236				П	-	现货:中债到期收益率(5年)		
2019/12/25 大学 12001 677 -0.44% -48.49											
T200	2019/12/25	T	3. 1463				-		现货・中债到期收益率(10年)		
Temporary Tem							_		76X-1 [XZI/M [XIII] - (10] /		
12005 638.5 -0.62% -86.99 Mx缩窄 RB2001 3695 -0.71% -370.67 Mx缩窄 Mx缩窄 RB2005 3485 -0.71% -370.67 Mx缩窄 Mx缩窄 Mx缩窄 L2005 7350 0.68% 100.00 Mx缩窄 Fxi	2019/12/24	铁矿	725. 49						现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价		
RB2005 3485 RB2005 3485 -0.71% -370.67 Sux缩窄 U2011 7235 0.42% -15.00 Sux缩窄 元税价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚 元税价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚 元税价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚 PP2001 7658 -0.23% -142.00 Sux缩窄 元税价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚 PP2001 7658 -0.23% -142.00 Sux缩窄 PP2001 7658 -0.23% -142.00 Sux缩窄 PP2001 6224 -0.66% 4.00 开水缩窄 PP2001 1203 0.21% -407.00 Sux缩帘 MR2005 1151.5 0.09% -458.50 Sux缩帘 元税价(观货基准价):PP粒(T30S):余姚 PP2011 1203 0.21% -407.00 Sux缩帘 元税价(金税):主焦煤(A10%, V24%, C0.8%S, G8O):	2013/12/24										
RB2005 3485 -0.718 -370.67 5.708	2019/12/25	螺纹	3856						现货价格:螺纹钢:HRB400 20mm:上海,扣除理计价格		
Table Tab								741.4 114 1	ACCOUNT OF THE PARTY OF THE PAR		
1.2005	2019/12/25	LLDPE	7250						完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海		
PP2005								7 7 7 7 7			
P2001 G224 P2005 G052 P2005	2019/12/25	PP	7800						市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚		
P2005 6052 0.07% -168.00 貼水缩窄 欠货が:係桐油:大洋港/丁仮港/貝埔港川原水后野 欠货が:係桐油:大洋港/丁仮港/貝埔港川原水后野 欠货が:係桐油:大洋港/丁仮港/貝埔港川原水后野 欠货が:係桐油:大洋港/丁仮港/貝埔港川原水后野 次度 次度 次度 次度 次度 次度 次度 次									. 24 pt 1 2 mp 1 mm 112 pt 1 2 7 2 7 4 7 7 M		
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): 2019/12/25 焦炭 2145 JZ001 1915 -0.36% -230.16 贴水扩大 天津港:平仓价(含税):主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80):	2019/12/25	棕榈油	6220					7 1 14 111 1	交货价: 棕榈油: 天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价		
1610 151.5 151											
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 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 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 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 2019/12/25 橡胶 11950 RU2001 12500 0.04% 550.00 贴水扩大 市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海 2019/12/25 豆油 6660 Y2001 6508 -0.12% -152.00 贴水扩大 现货价:回级豆油:大连 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.73% -185.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连 2019/12/25 豆粕 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价:空油:扩大 2019/12/25 豆粕 01001 7763 -0.09% <td rowspan="2">2019/12/25</td> <td rowspan="2">焦煤</td> <td rowspan="2">1610</td> <td>-</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td colspan="2" rowspan="2">京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80):河北</td>	2019/12/25	焦煤	1610	-					京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80):河北		
2019/12/25 無數 2145 J2005 1846 -0.43% -299.16 贴水扩大 (A<12.5%, <0.65%S, CSR>65%, Mt8%):山西产,水分折 2019/12/25 动力煤 549 ZC001 549.2 0.15% 0.70 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 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 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 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 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.73% -185.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连 2019/12/25 並油 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连				-			,				
2019/12/25 动力煤 549 ZC001 549.2 0.15% 0.70 开水缩窄 市场价:动力煤(Q5500, 山西产):秦皇岛 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 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 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 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 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.73% -185.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连 2019/12/25 豆粕 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连	2019/12/25	焦炭	2145	_					大津地: 十色扩(含枕): 一级石壶無 (A<12.5%, <0.65%S, CSR>65%, Mt8%): 山西产,水分折算后		
2019/12/25 切刀條 549 ZC005 552. 2 -0. 32% 3. 70 升水缩窄 市场价: 动刀條(Q5500, 山西产): 条星岛 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 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 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 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 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0. 73% -185. 00 贴水扩大 现货价: 豆粕:大连 2019/12/25 並油 8000 01001 7763 -0. 09% -237. 00 贴水扩大 现货价: 豆粕: 左衛								74.14			
2019/12/25 PTA 4850 TA001	2019/12/25	动力煤	549						市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛		
2019/12/25 PTA 4850 TA005 4960 -0.12% 110.00 升水缩窄 PTA: CCFE1价格指数: 精对本二甲酸PTA内蕴 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 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 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 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.73% -185.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连 2019/12/25 豆粕 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连							,				
2019/12/25 MA 2050 MA001 MA005 2164 0.93% 114.00 升水扩大 MACCOLL TOTAL TOT	2019/12/25	PTA	4850						PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘		
2019/12/25 MA 2050 MA005 2164 0.93% 114.00 升水扩大 MA: 市场估价(甲间价):甲醇:江苏田罐 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 2019/12/25 豆油 6660 Y2001 6508 -0.12% -152.00 贴水扩大 现水扩大 现货价:四级豆油:大连 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.73% -185.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连 2019/12/25 菜油 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价:菜油:安衡	2019/12/25	MA	2050				,		MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐		
2019/12/25 橡胶 11950 RU2001 RU2005 12500 0.04% 550.00 贴水缩窄 RU2005 时场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海 2019/12/25 豆油 6660 Y2001 6508 -0.12% -0.1											
2019/12/25 橡胶 11950 RU2005 12820 0.08% 870.00 开水扩大 市场价:大然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海 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 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.73% -185.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连 2019/12/25 菜油 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价:臺油:安衡	2019/12/25	橡胶	11950						市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海		
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 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.12% -92.00 贴水扩大 现货价:四级豆油:大连 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.73% -185.00 贴水扩大 现货价:豆粕:大连 2019/12/25 菜油 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价:菜油:安衡											
2019/12/25 豆粕 6660 Y2005 6568 -0.12% -92.00 贴水扩大 现货价: 四级豆油: 大连 2019/12/25 豆粕 2890 M2001 2705 -0.73% -185.00 贴水扩大 现货价: 豆粕: 大连 2019/12/25 並油 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价: 荥油: 安衡	2019/12/25	豆油	6660						现货价:四级豆油:大连		
2019/12/25 豆粕 2890 M2001											
2019/12/25 並油 2890 M2005 2742 -0.36% -148.00 贴水扩大 現货价: 豆柏: 入建 2019/12/25 並油 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 現货价: 並油: 安衡	2019/12/25	豆粕	2890				,	/4//4 4/ / -	现货价:豆粕:大连		
2019/12/25 艾油 8000 01001 7763 -0.09% -237.00 贴水扩大 现货价·艾油·安衡											
2019/12/25 桑州 8000 現俗作・桑油・安倒	2019/12/25	菜油	8000				_		现货价:菜油:安徽		
RM001 2192 -0.18% -111.89 陡水扩大	2019/12/25	 菜粕	2304				_	741.4			
2019/12/25 菜粕 2304 RM005 2276 0.18% -27.89 贴水缩窄 现货价: 平均价: 菜粕								747.4.4	现货价:平均价:菜粕		

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。



东兴期货 songxing futures	投资咨询部 2019/12/26	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)	10097.7629	10096.6600	1.1029				
贝亚文切	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				
	银行间质押式回购(1天)	1.0581	1. 1966	-0.1385				
→ 元 元 → M	银行间质押式回购(7天)	2.7481	1. 9888	0.7593				
宏观流动性	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				
<u>一级中场机</u> 列性	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。