



2020年1月7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	
2020/01/06	IF	4129.3	IF2001	4132.6	-0.46%	3.30	升水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF2002	4143.2	-0.45%	13.90	升水缩窄	
2020/01/06	IC	5434.9	IC2001	5433	1.02%	-1.85	贴水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC2002	5422.4	1.09%	-12.45	贴水缩窄	
2020/01/06	IH	3056.8	IH2001	3058.4	-0.71%	1.56	升水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH2002	3066	-0.74%	9.16	升水缩窄	
2020/01/06	TS	2.5048	TS2003	100.345	0.02%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2006	100.145	0.00%	-	-	
2020/01/06	TF	2.9059	TF2003	99.92	0.15%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2006	99.595	0.15%	-	-	
2020/01/06	T	3.1352	T2003	98.18	0.21%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2006	97.745	0.16%	-	-	
2020/01/03	铁矿	742.16	I2005	668	0.30%	-74.16	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2009	615	0.33%	-127.16	贴水缩窄	
2020/01/06	螺纹	3866	RB2005	3559	0.45%	-306.98	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2009	3441	0.23%	-424.98	贴水缩窄	
2020/01/06	LLDPE	7300	L2005	7440	1.22%	140.00	升水扩大	完税自提价(低端价):线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级):上海
			L2009	7485	1.15%	185.00	升水扩大	
2020/01/06	PP	7600	PP2005	7617	1.30%	17.00	升水扩大	市场价(现货基准价):PP粒(T30S):余姚
			PP2009	7655	1.18%	55.00	升水扩大	
2020/01/06	棕榈油	6600	P2005	6328	0.22%	-272.00	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
			P2009	6016	0.07%	-584.00	贴水扩大	
2020/01/06	焦煤	1610	JM2005	1178	-0.04%	-432.00	贴水扩大	京唐港:库提价(含税):主焦煤(A10%,V24%,<0.8%S,G80):河北产
			JM2009	1154	0.00%	-456.00	贴水扩大	
2020/01/06	焦炭	2196	J2005	1883	0.86%	-313.24	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
			J2009	1844	0.74%	-352.24	贴水缩窄	
2020/01/06	动力煤	559	ZC005	552.8	0.11%	-6.20	贴水缩窄	市场价:动力煤(Q5500,山西产):秦皇岛
			ZC009	547.2	0.15%	-11.80	贴水缩窄	
2020/01/06	PTA	4975	TA005	5098	1.72%	123.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数:精对苯二甲酸PTA内盘
			TA009	5130	1.34%	155.00	升水扩大	
2020/01/06	MA	2310	MA005	2297	2.64%	-13.00	贴水扩大	MA: 市场估价(中间价):甲醇:江苏出罐
			MA009	2262	1.80%	-48.00	贴水扩大	
2020/01/06	橡胶	12200	RU2001	12735	1.92%	535.00	升水缩窄	市场价:天然橡胶:云南国营全乳胶(SCR5):上海
			RU2005	13095	2.22%	895.00	升水缩窄	
2020/01/06	豆油	7020	Y2005	6826	0.21%	-194.00	贴水缩窄	现货价:四级豆油:大连
			Y2009	6672	0.06%	-348.00	贴水缩窄	
2020/01/06	豆粕	2860	M2005	2739	-0.80%	-121.00	贴水缩窄	现货价:豆粕:大连
			M2009	2739	-0.80%	-121.00	贴水缩窄	
2020/01/06	菜油	8200	OI005	7740	0.01%	-460.00	贴水缩窄	现货价:菜油:安徽
			OI009	7626	-0.09%	-574.00	贴水缩窄	
2020/01/06	菜粕	2338	RM005	2308	-0.90%	-30.33	贴水缩窄	现货价:平均价:菜粕
			RM009	2346	-0.85%	7.67	升水扩大	

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

 <b>东兴期货</b> 投资咨询部     2020/01/07		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）	10261.0900	10250.1400	10.9500
	沪股通净流入（亿元）	8.0511	14.1492	-6.0981
	深股通净流入（亿元）	35.5010	19.4593	16.0417
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.0874	1.2407	-0.1533
	银行间质押式回购（7天）	2.2084	2.2612	-0.0528
	Shibor（1天）	1.0030	1.1620	-0.1590
	Shibor（7天）	2.2190	2.3490	-0.1300
二级市场流动性	沪市质押式回购	3.0350	3.0850	-0.0500
	深市质押式回购	2.0500	2.5320	-0.4820
期指操作建议	两市量能创逾8个月新高，北向资金净流入，期指多单续持。			
黑色操作建议	唐山解除重污染响应，螺纹或偏强震荡。			
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。