



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2020年1月10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						
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:
2020/01/09	IF	4164.4	IF2001	4166.4	0.99%	2.03	升水缩窄	现货价格: 沪深300指数
			IF2002	4174	1.02%	9.63	升水缩窄	
2020/01/09	IC	5497.5	IC2001	5498	1.19%	0.46	升水缩窄	现货价格: 中证500指数
			IC2002	5491.8	1.31%	-5.74	贴水扩大	
2020/01/09	IH	3067.5	IH2001	3067.6	0.69%	0.05	升水缩窄	现货价格: 上证50指数
			IH2002	3075	0.81%	7.45	升水缩窄	
2020/01/09	TS	2.5122	TS2003	100.415	0.04%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2006	100.21	0.03%	-	-	
2020/01/09	TF	2.8961	TF2003	100.06	0.14%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2006	99.675	0.13%	-	-	
2020/01/09	T	3.1184	T2003	98.23	0.12%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2006	97.815	0.13%	-	-	
2020/01/08	铁矿	750.49	I2005	657	-3.31%	-93.49	贴水缩窄	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2009	612	-2.78%	-138.49	贴水缩窄	
2020/01/09	螺纹	3866	RB2005	3555	-1.71%	-310.98	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2009	3449	-1.29%	-416.98	贴水缩窄	
2020/01/09	LLDPE	7300	L2005	7380	-1.34%	80.00	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	7405	-1.46%	105.00	升水扩大	
2020/01/09	PP	7600	PP2005	7617	-0.14%	17.00	升水扩大	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2009	7633	-0.34%	33.00	升水扩大	
2020/01/09	棕榈油	6630	P2005	6386	1.11%	-244.00	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
			P2009	6046	0.90%	-584.00	贴水缩窄	
2020/01/09	焦煤	1610	JM2005	1202.5	-0.33%	-407.50	贴水扩大	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产
			JM2009	1176	-0.47%	-434.00	贴水扩大	
2020/01/09	焦炭	2196	J2005	1879.5	-1.52%	-316.74	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	1835	-1.50%	-361.24	贴水缩窄	
2020/01/09	动力煤	558	ZC005	556.6	-0.29%	-0.90	贴水缩窄	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC009	550.4	-0.22%	-7.10	贴水缩窄	
2020/01/09	PTA	4830	TA005	4910	-2.42%	80.00	升水扩大	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA009	4938	-2.57%	108.00	升水扩大	
2020/01/09	MA	2260	MA005	2239	-4.23%	-21.00	贴水缩窄	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA009	2217	-3.31%	-43.00	贴水缩窄	
2020/01/09	橡胶	12350	RU2005	12965	-1.71%	615.00	升水缩窄	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2009	13160	-1.64%	810.00	升水缩窄	
2020/01/09	豆油	6980	Y2005	6926	1.14%	-54.00	贴水缩窄	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2009	6752	0.96%	-228.00	贴水缩窄	
2020/01/09	豆粕	2850	M2005	2716	-0.40%	-134.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M2009	2716	-0.40%	-134.00	贴水扩大	
2020/01/09	菜油	8160	OI005	7827	1.36%	-333.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI009	7650	0.68%	-510.00	贴水缩窄	
2020/01/09	菜粕	2337	RM005	2314	-0.17%	-22.67	贴水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM009	2344	-0.55%	7.33	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

东兴期货 投资咨询部		2020/01/10		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）	10439.0600	10415.4500	23.6100		
	沪股通净流入（亿元）	32.6052	-4.1355	36.7407		
	深股通净流入（亿元）	42.9006	18.3650	24.5356		
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	1.7683	1.6387	0.1296		
	银行间质押式回购（7天）	2.5730	2.4962	0.0768		
	Shibor（1天）	1.6900	1.5530	0.1370		
	Shibor（7天）	2.4700	2.3200	0.1500		
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.3350	2.6850	-0.3500		
	深市质押式回购	1.3500	1.4200	-0.0700		
期指操作建议	今日公布12月新增信贷数据，两市成交超7000亿元，北向资金连续净流入，期指多单续持。					
黑色操作建议	社库累积超去年农历同期，螺纹05轻仓试空。					
化工操作建议	美伊冲突缓和，胶价重回基本面，震荡为主。					
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。