

2020年1月15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 | |
| 2020/01/14 | IF | 4189.9 | IF2001 | 4198.8 | -0.28% | 8.91 | 升水扩大 | 现货价格: 沪深300指数 |
| | | | IF2002 | 4206.2 | -0.33% | 16.31 | 升水扩大 | |
| 2020/01/14 | IC | 5542.3 | IC2001 | 5543.6 | -0.50% | 1.27 | 升水缩窄 | 现货价格: 中证500指数 |
| | | | IC2002 | 5535.2 | -0.46% | -7.13 | 贴水扩大 | |
| 2020/01/14 | IH | 3080.6 | IH2001 | 3087.2 | -0.20% | 6.60 | 升水扩大 | 现货价格: 上证50指数 |
| | | | IH2002 | 3093.4 | -0.19% | 12.80 | 升水扩大 | |
| 2020/01/14 | TS | 2.5118 | TS2003 | 100.45 | -0.05% | - | - | 现货: 中债到期收益率(2年) |
| | | | TS2006 | 100.205 | -0.04% | - | - | |
| 2020/01/14 | TF | 2.8936 | TF2003 | 100.13 | -0.05% | - | - | 现货: 中债到期收益率(5年) |
| | | | TF2006 | 99.675 | -0.06% | - | - | |
| 2020/01/14 | T | 3.0994 | T2003 | 98.44 | -0.06% | - | - | 现货: 中债到期收益率(10年) |
| | | | T2006 | 97.93 | -0.11% | - | - | |
| 2020/01/13 | 铁矿 | 738.8 | I2005 | 671.5 | 2.21% | -67.30 | 贴水扩大 | 现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价 |
| | | | I2009 | 621.5 | 1.89% | -117.30 | 贴水扩大 | |
| 2020/01/14 | 螺纹 | 3866 | RB2005 | 3570 | 1.13% | -295.98 | 贴水缩窄 | 现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格 |
| | | | RB2009 | 3452 | 0.70% | -413.98 | 贴水缩窄 | |
| 2020/01/14 | LLDPE | 7300 | L2005 | 7420 | -0.87% | 120.00 | 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 | 7455 | -0.93% | 155.00 | 升水扩大 | |
| 2020/01/14 | PP | 7600 | PP2005 | 7662 | -1.11% | 62.00 | 升水扩大 | 市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚 |
| | | | PP2009 | 7691 | -0.85% | 91.00 | 升水扩大 | |
| 2020/01/14 | 棕榈油 | 6570 | P2005 | 6222 | -2.54% | -348.00 | 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 | 5886 | -2.42% | -684.00 | 贴水扩大 | |
| 2020/01/14 | 焦煤 | 1610 | JM2005 | 1212 | 0.25% | -398.00 | 贴水缩窄 | 京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产 |
| | | | JM2009 | 1188 | 0.30% | -422.00 | 贴水缩窄 | |
| 2020/01/14 | 焦炭 | 2196 | J2005 | 1862 | 0.76% | -334.24 | 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 | 1821 | 0.55% | -375.24 | 贴水缩窄 | |
| 2020/01/14 | 动力煤 | 560 | ZC005 | 556.8 | 0.47% | -2.70 | 贴水缩窄 | 市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛 |
| | | | ZC009 | 550.2 | 0.44% | -9.30 | 贴水缩窄 | |
| 2020/01/14 | PTA | 4830 | TA005 | 4884 | -0.81% | 54.00 | 升水扩大 | PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘 |
| | | | TA009 | 4900 | -0.65% | 70.00 | 升水扩大 | |
| 2020/01/14 | MA | 2460 | MA005 | 2371 | 0.81% | -89.00 | 贴水缩窄 | MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐 |
| | | | MA009 | 2273 | -1.90% | -187.00 | 贴水扩大 | |
| 2020/01/14 | 橡胶 | 12500 | RU2001 | 12930 | 0.15% | 430.00 | 升水缩窄 | 市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海 |
| | | | RU2005 | 13250 | -0.86% | 750.00 | 升水缩窄 | |
| 2020/01/14 | 豆油 | 6850 | Y2005 | 6758 | -1.66% | -92.00 | 贴水缩窄 | 现货价: 四级豆油: 大连 |
| | | | Y2009 | 6636 | -1.31% | -214.00 | 贴水缩窄 | |
| 2020/01/14 | 豆粕 | 2830 | M2005 | 2659 | 0.15% | -171.00 | 贴水缩窄 | 现货价: 豆粕: 大连 |
| | | | M2009 | 2659 | 0.15% | -171.00 | 贴水缩窄 | |
| 2020/01/14 | 菜油 | 8160 | OI005 | 7817 | -0.98% | -343.00 | 贴水缩窄 | 现货价: 菜油: 安徽 |
| | | | OI009 | 7652 | -0.60% | -508.00 | 贴水缩窄 | |
| 2020/01/14 | 菜粕 | 2307 | RM005 | 2248 | -0.93% | -59.22 | 贴水缩窄 | 现货价: 平均价: 菜粕 |
| | | | RM009 | 2286 | -0.70% | -21.22 | 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 2020/01/15 | | 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） | 10515.1716 | 10455.9500 | 59.2216 |
| | 沪股通净流入（亿元） | 20.5079 | 25.7467 | -5.2388 |
| | 深股通净流入（亿元） | 13.7717 | 51.3580 | -37.5863 |
| 宏观流动性 | 银行间质押式回购（1天） | 2.6735 | 2.1433 | 0.5302 |
| | 银行间质押式回购（7天） | 3.0200 | 2.6426 | 0.3774 |
| | Shibor（1天） | 2.5180 | 2.0590 | 0.4590 |
| | Shibor（7天） | 2.6540 | 2.5220 | 0.1320 |
| 二级市场流动性 | 沪市质押式回购 | 3.0000 | 3.0250 | -0.0250 |
| | 深市质押式回购 | 2.7500 | 2.6460 | 0.1040 |
| 黑色操作建议 | 一季度预计发货量下降，铁矿05轻仓试多。 | | | |
| 化工操作建议 | 港口供应偏紧，MA05仍有上行空间。 | | | |
| 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。