

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货盘面	IF主力合约 (2609)	4566.8	+44.4↑	IF次主力合约 (2612)	4484.4	+45.0↑
	IH主力合约 (2609)	2888.8	+32.6↑	IH次主力合约 (2612)	2841.0	+30.8↑
	IC主力合约 (2609)	7708.8	+70.6↑	IC次主力合约 (2612)	7506.6	+67.2↑
	IM主力合约 (2609)	7491.8	+17.0↑	IM次主力合约 (2612)	7278.6	+15.8↑
	IF-IH当月合约价差	1678.0	+11.4↑	IC-IF当月合约价差	3142.0	+26.8↑
	IM-IC当月合约价差	-217.0	-46.4↓	IC-IH当月合约价差	4820.0	+38.2↑
	IM-IF当月合约价差	2925.0	-19.6↓	IM-IH当月合约价差	4603.0	-8.2↓
	IF当季-当月	-82.4	+1.6↑	IF下季-当月	-158.2	+5.2↑
	IH当季-当月	-47.8	-2.4↓	IH下季-当月	-84.2	-3.8↓
	IC当季-当月	-202.2	-1.2↓	IC下季-当月	-389	+1.8↑
	IM当季-当月	-213.2	+0.4↑	IM下季-当月	-418.4	+0.0↑
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	32,087.00	-984.0↓	IH前20名净持仓	18,757.00	+198.0↑
	IC前20名净持仓	31,057.00	-442.0↓	IM前20名净持仓	62,537.00	+121.0↑
现货价格	沪深300	4590.79	+38.8↑	IF主力合约基差	-24.0	+6.2↑
	上证50	2,905.1	+29.6↑	IH主力合约基差	-16.3	+4.0↑
	中证500	7,770.5	+59.6↑	IC主力合约基差	-61.7	+12.2↑
	中证1000	7,544.7	+17.2↑	IM主力合约基差	-52.9	+8.2↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	18,218.15	-224.63↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	26,559.67	-5.27↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	2674.21	-236.14↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	0.0	+2395.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+79.95	+119.72	MLF (到期量, 投放量, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	53.08	-23.23↓	Shibor (日, %)	1.412	-0.023↓
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2609)	67.80	+11.00↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	17.38	-0.82↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2609)	101.60	-34.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.14	-1.42↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.84	+0.10↑	成交量PCR (%)	63.15	-4.12↓
				持仓量PCR (%)	80.04	+2.88↑
行业消息	1、伊朗与阿曼发表联合声明，拟在霍尔木兹海峡建立一条双方共同商定的安全海上通道。伊朗外交部副部长加里巴巴迪表示，伊朗与阿曼达成霍尔木兹海峡谅解备忘录，并不代表海峡将从8月26日起恢复开放。根据协议，进入波斯湾和离开波斯湾的航线将分别经过伊朗和阿曼水域，加里巴巴迪形容其为“一条双向高速公路”，宽约7海里。加里巴巴迪指出，这条航道是临时性的，双方将在30至60天内谈判确定永久航线。 2、消息称美国与伊朗已达成停火协议，预计未来数日将正式对外宣布。这份网传协议包含霍尔木兹海峡航行自由以及依据伊斯兰堡备忘录重启谈判。美国与伊朗双方均尚未证实该协议。与此同时，有报道称，美国驻中东外交机构可能最早于本周开始让外交官返回，并逐步缩减此前采取的紧急措施。					 更多观点请咨询！
观点总结	A股主要指数收盘集体上涨。截止收盘，上证指数涨0.59%，深证成指涨0.69%，创业板指涨0.51%。沪深两市成交额微幅回落。大盘蓝筹股强于中小盘股。行业板块普遍上涨，非银金融板块领涨，综合板块领跌。海外方面，地缘局势上，伊朗与阿曼发表联合声明，拟在霍尔木兹海峡建立一条双方共同商定的安全海上通道。同时，有消息称美国与伊朗已达成停火协议，预计未来数日将正式对外宣布。美伊冲突有所缓和，令油价大幅回落，并带动美债收益率下行。国内方面，经济基本面，7月份，我国进出口、规上工业增加值、固投、社零多项指标集体回落，投资端尤为疲弱，但值得注意的是高技术产业的生产、投资、出口增速较6月呈现上升。上市公司基本面，目前已有过半数的上市公司披露半年报，其中中证500及上证50指数成分股净利增速分别为31%、28%。整体来看，原油与美债收益率回落，为市场提供喘息空间。最后，本周上市公司半年报披露进入冲刺阶段，市场波动预计放大，需密切观察半年报的整体情况。					 更多资讯请关注！

重点关注	8/26 20:30 美国7月PCE、核心PCE
	8/27 9:30 中国7月规上工业企业利润
	8/27-8/29 美联储“杰克逊霍尔全球央行年会”

数据来源第三方，观点仅供参考。市场有风险，投资需谨慎！

备注：IF:沪深300 IH:上证50 IC:中证500 IM：中证1000 IO:沪深300期权

研究员: 廖宏斌
期货从业资格号F30825507 期货投资咨询从业证书号Z0020723
微信号: yanjiufuwu
电话: 0595-86778969

免责声明：本报告中的信息均来源于公开可获得资料，瑞达期货股份有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

瑞达研究