

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)	4601.6	+9.2↑	IF次主力合约 (2612)	4523.0	+10.2↑
	IH主力合约 (2609)	2918.0	+8.4↑	IH次主力合约 (2612)	2862.8	+3.6↑
	IC主力合约 (2609)	7895.8	+43.8↑	IC次主力合约 (2612)	7706.0	+43.0↑
	IM主力合约 (2609)	7713.6	+45.2↑	IM次主力合约 (2612)	7501.0	+43.4↑
	IF-IH当月合约价差	1683.6	+1.4↑	IC-IF当月合约价差	3294.2	+34.0↑
	IM-IC当月合约价差	-182.2	+5.0↑	IC-IH当月合约价差	4977.8	+35.4↑
	IM-IF当月合约价差	3112.0	+39.0↑	IM-IH当月合约价差	4795.6	+40.4↑
	IF当季-当月	-78.6	-0.6↓	IF下季-当月	-152.8	-3.0↓
	IH当季-当月	-55.2	-5.6↓	IH下季-当月	-94.6	-4.8↓
	IC当季-当月	-189.8	-3.0↓	IC下季-当月	-368.8	-4.2↓
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	29,141.00	-1436.0↓	IH前20名净持仓	17,349.00	+4.0↑
	IC前20名净持仓	27,982.00	-3829.0↓	IM前20名净持仓	62,400.00	-1564.0↓
现货价格	沪深300	4625.09	+15.9↑	IF主力合约基差	-23.5	-7.9↓
	上证50	2,936.9	+13.6↑	IH主力合约基差	-18.9	-7.0↓
	中证500	7,952.1	+56.7↑	IC主力合约基差	-56.3	-14.7↓
	中证1000	7,770.4	+65.4↑	IM主力合约基差	-56.8	-18.4↓
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	21,453.56	+276.24↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	26,591.11	-60.0↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	2781.22	-67.87↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-6730.0	+4520.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-343.71	-56.78↓	MLF (到期量, 投放量, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	57.35	+3.07↑	Shibor (日, %)	1.413	+0.074↑
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2609)	49.20	+0.20↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	15.99	-0.15↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2609)	96.60	-6.40↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	15.67	+0.21↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.06	-0.39↓	成交量PCR (%)	62.97	+2.22↑
				持仓量PCR (%)	82.12	+0.97↑

行业消息	1、据国家统计局数据, 8月我国官方制造业PMI录得49.8, 前值49.2, 预期49.9; 非制造业PMI49.0, 前值49.0; 综合PMI录得49.5, 前值49.3。 2、据Wind数据, 截至8月31日, A股上市公司半年报已完成披露。上半年全A归母净利润同比增长15.94%,其中4040家上市公司归母净利为正, 2812家上市公司实现归母净利润同比正增长。四大宽基指数中, 沪深300净利同比增速为14.81%, 上证50净利同比增速为18.03%, 中证500净利同比增速为25%, 中证1000净利同比增速为8.69%。 3、当地时间8月30日晚, 伊朗南部霍尔木兹省拉腊克岛地区传出爆炸声。伊朗伊斯兰革命卫队发表声明称, 拉腊克岛遭袭造成包括平民在内的多人死伤, 敌人对拉腊克岛的侵略必将遭到报复, 侵略者必将受到惩罚。美国官员称, 美军对拉腊克岛上伊朗伊斯兰革命卫队两处发射装置进行了打击。伊朗媒体称, 伊朗向霍尔木兹海峡的美国舰艇发射了导弹。 4、美联储主席沃什在杰克逊霍尔全球央行年会发表演讲, 释放出明确的鹰派信号。沃什表示, 如果美国基础通胀不能清晰且足够快速地向2%目标回落, 美联储“还有工作要做”。尽管今年夏季PCE和CPI数据均好于预期, 沃什对此仍持谨慎态度。沃什指出, 通胀底层趋势已出现实质性改善, 价格稳定并不会自动实现, 通胀也不一定会自行回归目标。沃什重申, 2%的通胀目标“坚定不移、不容更改”, 美联储将确保物价稳定最终实现。	 更多观点请咨询!
观点总结	A股主要指数收盘集体上涨, 三大指数低开高走, 午后集体翻红。截止收盘, 上证指数涨0.86%, 深证成指涨0.44%, 创业板指涨0.42%。沪深两市成交额微幅回升。中小盘股略强于大盘蓝筹股。行业板块涨跌不一, 传媒板块大幅走强, 有色金属板块领跌。海外方面, 地缘局势上, 美国时隔近一个月再度打击伊朗, 伊朗亦进行还击。地缘局势升温推高油价。货币政策上, 美联储主席沃什在杰克逊霍尔全球央行年会发表演讲, 释放出明确的鹰派信号。油价上涨叠加沃什的强硬表态, 使得美债收益率出现大幅走高, 10年期美债收益率重回4.7%。国内方面, 经济基本面, 8月份, 国内制造业PMI出现小幅回升, 但仍处于收缩区间, 制造业PMI子指标中的新订单与新出口订单均回升至扩张区间, 暗示内外需有好转可能。同时, 高技术与装备制造业PMI仍处具有扩张区间。上市公司基本面, 目前上市公司半年报已全部披露完毕, 全体A股上市公司净利增速达16%, 四期指中中证500及上证50指数成分股净利增速分别为25%、18%。整体来看, 国内经济K型分化仍在延续。上市公司半年报情况良好, 对市场有底层逻辑支撑。但海外地缘局势再度紧张以及沃什在全球央行年会的鹰派发言, 令原油与美债收益率再度走高, 对市场施加一定压力。	 更多资讯请关注!

重点关注	9/1 22:00 美国7月JOLTS职位空缺、8月ISM制造业PMI
	9/2 20:15 美国8月ADP就业人数
	9/3 17:30 美国8月挑战者企业裁员人数；22:00 美国8月ISM非制造业PMI
	9/4 20:30 美国8月非农就业人数、失业率、劳动参与率

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