

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)	4644.6	+8.6↑	IF次主力合约 (2608)	4675.2	+8.8↑
	IH主力合约 (2609)	2936.0	+11.4↑	IH次主力合约 (2608)	2956.0	+12.2↑
	IC主力合约 (2609)	7881.4	+26.2↑	IC次主力合约 (2608)	7955.2	+40.6↑
	IM主力合约 (2609)	7607.2	+42.6↑	IM次主力合约 (2608)	7682.8	+53.0↑
	IF-IH当月合约价差	1719.2	-6.6↓	IC-IF当月合约价差	3280.0	+18.0↑
	IM-IC当月合约价差	-272.4	+8.2↑	IC-IH当月合约价差	4999.2	+11.4↑
	IM-IF当月合约价差	3007.6	+26.2↑	IM-IH当月合约价差	4726.8	+19.6↑
	IF当季-当月	-110.0	-1.4↓	IF下季-当月	-186.2	-5.0↓
	IH当季-当月	-62.8	-1.4↓	IH下季-当月	-90.2	-1.4↓
	IC当季-当月	-247.6	-27.0↓	IC下季-当月	-416	-37.8↓
	IM当季-当月	-269.6	-14.0↓	IM下季-当月	-462.8	-24.2↓
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	33,326.00	-527.0↓	IH前20名净持仓	20,343.00	-422.0↓
	IC前20名净持仓	31,552.00	-1817.0↓	IM前20名净持仓	62,632.00	-1572.0↓
现货价格	沪深300	4702.02	+7.6↑	IF主力合约基差	-57.4	-8.6↓
	上证50	2,967.7	+7.3↑	IH主力合约基差	-31.7	-1.3↓
	中证500	8,031.0	+50.8↑	IC主力合约基差	-149.5	-47.2↓
	中证1000	7,733.9	+54.4↑	IM主力合约基差	-126.7	-37.8↓
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	25,387.11	-1446.90↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	26,475.41	+76.82↑
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	3451.50	+189.33↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-630.0	+180.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+364.39	-414.67↓	MLF (到期量, 投放量, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	73.50	+21.91↑	Shibor (日, %)	1.377	+0.016↑
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2608)	49.00	-2.60↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	16.36	-0.37↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2608)	70.20	-6.40↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	16.36	-0.22↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	26.02	-0.74↓	成交量PCR (%)	67.31	+7.04↑
				持仓量PCR (%)	74.25	+0.19↑
行业消息	1、美国劳工统计局公布数据显示, 美国7月非农就业人数减少2.3万, 远不及市场预期的增加8万; 5月和6月非农就业数据合计下修10.3万人。美国7月失业率降至4.1%, 平均时薪环比仅增长0.1%, 也不及预期。 2、国家统计局公布数据显示, 7月, 我国CPI环比下降0.1%, 前值下降0.3%, 同比上涨0.5%, 前值上涨0.1%; 核心CPI环比上涨0.3%, 同比上涨0.9%; PPI环比下降0.7%, 前值降0.3%, 同比上涨3.5%, 前值上涨4.1%。 3、伊朗外长阿拉格齐表示, 目前伊朗与美国之间没有进行任何谈判, 但斡旋方仍在努力寻找恢复谈判的途径。伊朗认为, 在美国就此违反相关承诺的行为作出弥补之前, 不具备重新启动谈判的条件。阿拉格齐还表示, 伊朗正与阿曼就调整霍尔木兹海峡航道进行磋商, 目前已进入最后阶段。即使双方就航道调整达成协议, 也不意味着霍尔木兹海峡重新开放, 海峡重新开放仍需满足一系列条件。阿拉格齐称, 目前双方讨论以新航道取代原有航道, 相关专家正在开展技术工作。					 更多观点请咨询!
观点总结	A股主要指数收盘多数上涨, 三大指数高开低走表现分化。截止收盘, 上证指数涨0.67%, 深证成指涨0.04%, 创业板指跌0.73%。沪深两市成交额有所回落。中小盘股强于大盘蓝筹股。全市场近4100只个股上涨。行业板块普遍上涨, 农林牧渔板块大幅走强, 通信、电子、计算机板块走弱。海外方面, 经济数据上, 美国7月非农意外录得负增长, 劳动市场走弱使得市场对美联储9月加息预期降至40%附近。地缘局势上, 伊朗方面表示, 美国目前暂不具备重启谈判的条件。美伊谈判再度陷入僵局, 油价与美债收益率今日开盘跳空上涨, 但很快回落。国内方面, 经济基本面, 贸易端, 7月份, 我国进口、出口增速均小幅回落, 但仍保持两位数增速, 同时高新技术产品出口增速较6月进一步上升; 物价端, 受到油价传导滞后的影响, 7月份国际油价上涨尚未对CPI、PPI增速产生影响, CPI、PPI同比均走弱。上市公司基本面, 已披露半年报的少部分公司财报表现良好, 中证500指数净利增速超60%。整体来看, 伊朗在谈判上维持强硬态度, 令原油与美债收益率再度上行, 对市场形成一定压力。但国内7月进出口数据依旧维持高增长, 且高技术产品的出口依旧强劲。外需支撑经济基本面。同时, 上市公司盈利目前呈现极高增速, 但由于数量较少, 且业绩好的公司通常率先披露, 因此, 半年报的整体情况仍有待观察。					 更多资讯请关注!

重点关注	待定 中国7月金融数据
	8/12 22:30 美国7月CPI、核心CPI
	8/13 22:30 美国7月PPI、核心PPI
	8/14 20:30 美国7月零售销售

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