

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 (2512)	4670.8	+64.2↑	IF次主力合约 (2511)	4683.8	+64.0↑
	IH主力合约 (2512)	3041.4	+31.4↑	IH次主力合约 (2511)	3043.0	+32.0↑
	IC主力合约 (2512)	7246.4	+120.4↑	IC次主力合约 (2511)	7304.6	+118.8↑
	IM主力合约 (2512)	7405.0	+75.2↑	IM次主力合约 (2511)	7487.8	+79.6↑
	IF-IH当月合约价差	1640.8	+34.6↑	IC-IF当月合约价差	2620.8	+61.4↑
	IM-IC当月合约价差	183.2	-38.4↓	IC-IH当月合约价差	4261.6	+96.0↑
	IM-IF当月合约价差	2804.0	+23.0↑	IM-IH当月合约价差	4444.8	+57.6↑
	IF当季-当月	-45.8	-3.6↓	IF下季-当月	-85	-3.4↓
	IH当季-当月	-5.0	-4.2↓	IH下季-当月	-10.2	-5.0↓
	IC当季-当月	-226.6	+3.6↑	IC下季-当月	-411.6	+4.8↑
	IM当季-当月	-301.0	-3.0↓	IM下季-当月	-513.2	-7.8↓
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-28,077.00	+1771.0↑	IH前20名净持仓	-15,051.00	-710.0↓
	IC前20名净持仓	-23,040.00	+2822.0↑	IM前20名净持仓	-36,449.00	-154.0↓
现货价格	沪深300	4693.40	+66.2↑	IF主力合约基差	-22.6	+8.1↑
	上证50	3,044.7	+36.8↑	IH主力合约基差	-3.3	+2.0↑
	中证500	7,345.7	+116.4↑	IC主力合约基差	-99.3	+22.0↑
	中证1000	7,551.8	+87.0↑	IM主力合约基差	-146.8	+7.2↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	20,759.04	+1815.64↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	24,914.78	-1.44↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	2286.82	-122.28↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-3426.0	+928.0↑
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-126.28	+11.65↑	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	52.88	-9.19↓	Shibor (日, %)	1.313	-0.002↓
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价 (2511)	47.20	+20.80↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	13.85	-0.76↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2511)	63.80	-53.40↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	13.85	-1.74↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	18.17	-0.05↓	成交量PCR (%)	58.70	-18.02↓
				持仓量PCR (%)	86.31	+7.18↑
	全部A股	6.30	0.00	技术面	5.30	-0.90↓
行业消息	资金面	7.30	+0.90↑			
	1、据Wind资讯数据统计, 截至11月5日, 年内1035家公司宣布中期分红(含季报、半年报分红、特殊分红), 分红金额合计7356.86亿元, 已经超过去年中期分红金额。其中, 316家公司是首次中期分红。					
	2、中方公布落实中美吉隆坡经贸磋商共识具体举措。其中包括: 停止实施3月4日公布的对原产于美国的部分进口商品加征关税; 继续暂停24%对等关税一年, 保留10%加征税率; 对15家美国实体停止出口管制措施, 对另外16家实体继续暂停一年; 对11家美国企业停止实施不可靠实体清单措施, 对另外11家企业继续暂停一年; 停止实施对原产于美国的进口相关截长波长位移单模光纤的反规避措施。					
观点总结	3、美国10月ADP就业人数增加4.2万人, 大幅超过预期的3万人, 上月数据修正后为减少2.9万人。					
		更多观点请咨询!				
	A股主要指数收盘集体上涨。三大指数高开高走, 全天维持强势。截止收盘, 上证指数涨0.97%, 深证成指涨1.73%, 创业板指涨1.84%。沪深两市成交额回升至两万亿。行业板块多数上涨, 有色金属、电子板块大幅走强, 传媒、社会服务、商贸零售板块领跌。国内方面, 经济基本面, 10月我国制造业PMI为49%, 比上月下降0.8个百分点, 已连续七个 月处于荣枯线下方。制造业景气不佳对市场情绪有负面影响。贸易端, 商务部发言人表示, 中美双方将各自取消多项 相互加征的关税措施。个股方面, 上市公司三季报的披露情况来看, 四期指中, 沪深300、上证50、中证500净利增速均 较半年报加快, 中证1000净利降幅亦呈现收敛态势。整体来看, A股三季报整体表现良好, 对市场起到底部支撑, 但 10月份国内制造业景气下滑对后续市场走势有一定压制, 此外中美两国元首会晤和吉隆坡经贸谈判细节后, 短期内 暂无更多利好消息释放, 市场有利好出尽态势。目前, 在A股三季报披露完毕后, 加上月内国内暂无重要会议召开, 市 场处于政策与业绩真空期, 在缺乏明确交易指引的环境下, 市场预计呈现随机游走的态势, 股指将维持震荡。策略上, 建议暂时观望。					
		更多资讯请关注!				

11/7 9:30 中国10月贸易数据
11/9 9:30 中国10月CPI、PPI

重点关注

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，客户应考虑本报告中的任何意见或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