

| 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) | 4672.0 | +13.0↑ | IF次主力合约 (2511) | 4686.2 | +13.2↑ |
| | IH主力合约 (2512) | 3054.0 | +13.8↑ | IH次主力合约 (2511) | 3054.8 | +13.6↑ |
| | IC主力合约 (2512) | 7235.8 | +5.0↑ | IC次主力合约 (2511) | 7302.8 | +10.4↑ |
| | IM主力合约 (2512) | 7421.0 | +9.4↑ | IM次主力合约 (2511) | 7508.8 | +16.2↑ |
| | IF-IH当月合约价差 | 1631.4 | -2.8↓ | IC-IF当月合约价差 | 2616.6 | -2.4↓ |
| | IM-IC当月合约价差 | 206.0 | +4.6↑ | IC-IH当月合约价差 | 4248.0 | -5.2↓ |
| | IM-IF当月合约价差 | 2822.6 | +2.2↑ | IM-IH当月合约价差 | 4454.0 | -0.6↓ |
| | IF当季-当月 | -46.2 | +0.6↑ | IF下季-当月 | -90.8 | -4.8↓ |
| | IH当季-当月 | -5.2 | -1.0↓ | IH下季-当月 | -11.2 | 0.0 |
| | IC当季-当月 | -237.8 | -7.2↓ | IC下季-当月 | -428 | -11.0↓ |
| | IM当季-当月 | -309.6 | -7.2↓ | IM下季-当月 | -524.6 | -6.2↓ |
| 期货持仓头寸 | IF前20名净持仓 | -26,057.00 | -1661.0↓ | IH前20名净持仓 | -14,565.00 | -343.0↓ |
| | IC前20名净持仓 | -21,784.00 | -2150.0↓ | IM前20名净持仓 | -37,541.00 | +466.0↑ |
| 现货价格 | 沪深300 | 4695.05 | +16.3↑ | IF主力合约基差 | -23.1 | -3.7↓ |
| | 上证50 | 3,053.9 | +15.5↑ | IH主力合约基差 | 0.1 | +0.3↑ |
| | 中证500 | 7,343.8 | +15.9↑ | IC主力合约基差 | -108.0 | -10.3↓ |
| | 中证1000 | 7,563.3 | +21.4↑ | IM主力合约基差 | -142.3 | -12.4↓ |
| 市场情绪 | A股成交额 (日, 亿元) | 21,943.71 | +1741.66↑ | 两融余额 (前一交易日, 亿元) | 24,936.93 | -51.56↓ |
| | 北向成交合计 (前一交易日, 亿元) | 2358.56 | -83.50↓ | 逆回购 (到期量, 操作量, 亿元) | -783.0 | +1199.0↑ |
| | 主力资金 (昨日, 今日, 亿元) | -471.62 | -371.00↓ | MLF (续作量, 净投放, 亿元) | | |
| | 上涨股票比例 (日, %) | 62.00 | +23.42↑ | Shibor (日, %) | 1.479 | +0.152↑ |
| Wind市场强弱分析 | IO平值看涨期权收盘价 (2511) | 42.80 | +5.20↑ | IO平值看涨期权隐含波动率 (%) | 13.43 | +0.21↑ |
| | IO平值看跌期权收盘价 (2511) | 54.40 | -11.60↓ | IO平值看跌期权隐含波动率 (%) | 13.43 | -0.07↓ |
| | 沪深300指数20日波动率 (%) | 16.63 | -0.11↓ | 成交量PCR (%) | 67.93 | -5.18↓ |
| | 持仓量PCR (%) | | | 持仓量PCR (%) | 87.08 | -1.04↓ |
| 行业消息 | 全部A股 | 6.30 | +2.10↑ | 技术面 | 6.20 | +2.40↑ |
| | 资金面 | 6.50 | +2.00↑ | | | |
| 观点总结 | 1、国家统计局公布，10月份，CPI环比上涨0.2%，前值涨0.1%；同比上涨0.2%，前值降0.3%；扣除食品和能源价格的核心CPI同比上涨1.2%。10月份，PPI环比涨0.1%，前值持平；同比降2.1%，前值降2.3%。 | | | | | |
| | <p>A股主要指数收盘普遍上涨。三大指数高开后表现分化，上证指数于4000点附近拉锯。截止收盘，上证指数涨0.53%，深成指涨0.18%，创业板指跌0.92%。沪深两市成交额明显回升。全市场近3400只个股上涨。行业板块多数上涨，美容护理、食品饮料板块大幅走强，电力设备板块领跌。国内方面，经济基本面，物价层面，在反内卷政策持续推动，以及中秋国庆假期的带动下，10月份国内CPI、PPI同比、环比涨幅均较上月回升，通胀回升对居民消费与企业投资均有提振作用。外需层面，受美国再度加征关税影响，10月我国进出口贸易，较9月明显回落，此前公布的制造业PMI项目下的新出口订单指数亦较9月大幅回落1.9个百分点，外需有走弱的迹象。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，但在前三季度支撑GDP的外需，在10月份大幅回落对四季度经济基本面预计产生拖累，对股市情绪有一定负面影响。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。</p> | | | | | |
| | | | |  更多观点请咨询！ | | |
| | | | |  更多资讯请关注！ | | |

待定 中国10月金融数据

11/13 21:30 美国10月CPI、核心CPI

11/14 10:00 中国10月规上工业增加值、固定资产投资、社会消费品零售总额、房地产数据、失业率

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。

