

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)	4554.0	+11.0↑	IF次主力合约 (2608)	4587.0	+10.4↑
	IH主力合约 (2609)	2858.8	+4.2↑	IH次主力合约 (2608)	2880.2	+3.0↑
	IC主力合约 (2609)	7761.0	+56.0↑	IC次主力合约 (2608)	7842.0	+54.4↑
	IM主力合约 (2609)	7516.2	+57.0↑	IM次主力合约 (2608)	7585.0	+56.6↑
	IF-IH当月合约价差	1706.8	+5.6↑	IC-IF当月合约价差	3255.0	+45.8↑
	IM-IC当月合约价差	-257.0	+3.2↑	IC-IH当月合约价差	4961.8	+51.4↑
	IM-IF当月合约价差	2998.0	+49.0↑	IM-IH当月合约价差	4704.8	+54.6↑
	IF当季-当月	-108.0	+1.8↑	IF下季-当月	-175.4	+4.8↑
	IH当季-当月	-61.8	+4.2↑	IH下季-当月	-92	+3.0↑
	IC当季-当月	-271.0	+0.2↑	IC下季-当月	-443.6	+2.2↑
	IM当季-当月	-271.6	-0.4↓	IM下季-当月	-456.8	+2.4↑
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	28,129.00	+1612.0↑	IH前20名净持仓	17,683.00	-248.0↓
	IC前20名净持仓	28,151.00	-1272.0↓	IM前20名净持仓	54,987.00	+147.0↑
现货价格	沪深300	4592.75	+4.1↑	IF主力合约基差	-38.8	-4.3↓
	上证50	2,881.4	-14.1↓	IH主力合约基差	-22.6	+7.9↑
	中证500	7,850.4	+66.9↑	IC主力合约基差	-89.4	-17.9↓
	中证1000	7,589.8	+72.0↑	IM主力合约基差	-73.6	-24.6↓
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	20,939.09	-4361.02↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	26,676.05	-303.09↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	3284.65	+208.25↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-3274.0	0.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-1939.64	-44.50↓	MLF (到期量, 投放量, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	73.87	+65.82↑	Shibor (日, %)	1.384	+0.003↑
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2608)	18.60	-9.20↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	20.92	-0.76↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2608)	31.80	-14.00↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	20.92	-0.76↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	20.22	-0.03↓	成交量PCR (%)	72.99	-13.53↓
				持仓量PCR (%)	72.75	+1.03↑
行业消息	1、美联储7月会议纪要显示,许多与会者评估,若通胀未能回落,则可能需要进一步加息。部分官员称立即加息有助于避免后续更大幅度的加息。部分与会者表示,当前金融环境紧缩力度或许不足以将通胀拉回2%目标。 2、美国财政部宣布,对长期国债的流动性支持回购规模将“至少扩大一倍”,由20亿美元提高至40亿美元,回购对象涵盖10年期至30年期债券。 3、美国总统特朗普8月19日表示,可能在“某个时候”恢复与伊朗谈判,但伊朗必须彻底放弃核武器。特朗普18日曾在社交媒体上称,目前和未来不会与伊朗进行任何会谈或对话。伊朗议会国家安全与外交政策委员会委员雷扎伊表示,若伊朗在世界任何地方的利益受到损害,伊朗将通过提高关税或没收资产等方式,在霍尔木兹海峡对敌对国家和政府进行反制。					
观点总结	A股主要指数收盘多数上涨,三大指数高开低走,尾盘出现反弹。截止收盘,上证指数涨0.24%,深证成指涨0.59%,创业板指涨0.64%。沪深两市成交额明显回落。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,医药生物板块明显走强,国防军工板块领跌。海外方面,地缘局势上,特朗普对伊朗态度出现反转,表示可能在“某个时候”恢复与伊朗谈判,但伊朗必须彻底放弃核武器。金融政策上,美国财政部宣布将加大长期国债回购规模,但美联储7月会议纪要呈现出较强的鹰派色彩。今日长期美债收益率先抑后扬,保持在4.6%上方。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,已披露半年报的部分公司业绩表现良好,中证500指数净利增速达47%。整体来看,原油与美债收益率处在关键点位上方,市场压力尚未缓解。同时,宏观基本面对股市带来的压力依旧明显,高科技产业与传统产业分化持续。最后,上市公司盈利目前呈现高增速,但由于数量不多,因此,半年报的整体情况仍有待观察。					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

重点关注	8/21 15:15-16:30 法国、德国、欧元区、英国8月标普全球制造业、服务业、综合PMI; 21:45 美国8月标普全球制造业、服务业、综合PMI
------	---

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