

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(2402)	3213.6	-6.0↓	IF次主力合约(2403)	3181.0	-10.0↓
	IH主力合约(2402)	2245.8	-13.0↓	IH次主力合约(2403)	2237.2	-18.6↓
	IC主力合约(2402)	4648.8	-37.2↓	IC次主力合约(2403)	4488.0	-47.2↓
	IM主力合约(2402)	4699.2	-52.8↓	IM次主力合约(2403)	4521.4	-45.8↓
	IF-IH当月合约价差	967.8	+11.4↑	IC-IF当月合约价差	1435.2	-10.2↓
	IM-IC当月合约价差	50.4	-19.4↓	IC-IH当月合约价差	2403.0	+1.2↑
	IM-IF当月合约价差	1485.6	-29.6↓	IM-IH当月合约价差	2453.4	-18.2↓
	IF当季-当月	-32.6	-2.4↓	IF下季-当月	-68	0.0
	IH当季-当月	-8.6	-3.8↓	IH下季-当月	-41.2	-5.6↓
	IC当季-当月	-160.8	-2.4↓	IC下季-当月	-234.6	-9.4↓
IM当季-当月	-177.8	+5.4↑	IM下季-当月	-258.2	+7.6↑	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-55,965.00	-356.0↓	IH前20名净持仓	-30,230	+281.0↑
	IC前20名净持仓	-22,613.00	+787.0↑	IM前20名净持仓	-34015	+650.0↑
现货价格	沪深300	3217.71	+2.4↑	IF主力合约基差	-4.1	-3.3↓
	上证50	2248.27	-6.0↓	IH主力合约基差	-2.5	+1.3↑
	中证500	4678.73	-18.3↓	IC主力合约基差	-29.9	-39.6↓
	中证1000	4750.44	-34.6↓	IM主力合约基差	-51.2	-57.8↓
市场情绪	A股成交额(日, 亿元)	7,108.76	-561.31↓	两融余额(前一交易日, 亿元)	15,663.62	-210.39↓
	陆股通(昨日, 今日, 亿元)	+37.01	+27.26↑	逆回购(到期量, 操作量, 亿元)	-4660	+430
	主力资金(昨日, 今日, 亿元)	-323.10	-63.53↓	MLF(续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例(日, %)	20.63	+11.53↑	Shibor(日, %)	1.676	+0.058↑
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价(2402)	60.00	-4.20↓	IO平值看涨期权隐含波动率(%)	25.90	-1.06↓
	IO平值看跌期权收盘价(2402)	45.40	-5.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率(%)	26.10	-1.55↓
	沪深300指数20日波动率(%)	17.24	-0.16↓	成交量PCR(%)	110.00	-26.24↓
	全部A股	3.20	+1.00↑	持仓量PCR(%)	48.37	+0.05↑
资金面	4.30	+0.90↑	技术面	2.10	+1.20↑	
行业消息	1、2月1日公布的2024年1月财新中国制造业采购经理指数 (PMI) 录得50.8, 与上月持平。自2021年6月以来, 该指数首次连续三个月位于扩张区间。					
观点总结	A股主要指数走势分化。大盘午后冲高回落。截至收盘, 沪指跌0.64%, 深证成指涨0.34%, 创业板指涨1%。四期指均收跌, 中小股指表现更弱。沪深两市成交量回落, 北向资金连续净流入。近期来看, 从央行超预期降准到全面暂停限售股出借, A股市场政策环境持续吹暖风, 四季度以来宽基ETF资金净流入加速, 产业资本减持减少和回购股票增加, 近期政策面和资金面的积极信号边际增多, 对2月市场行情的走势或比较有利。策略上, 随着市场步入低位, IC/IM维持贴水格局, 建议多近空远跨期套利。短线策略或可考虑跨品种价差持有, 多IF空IM为主。					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

2-1 23: 00 美国1月ISM制造业指数

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3

蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101

助理研究员：

廖宏斌 期货从业资格号F3082507

王世霖 期货从业资格号F03118150

曾奕蓉 期货从业资格号F03105260

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