

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 (2503)	4003.4	+13.8↑	IF次主力合约 (2501)	3999.2	+13.2↑
	IH主力合约 (2503)	2728.2	+15.8↑	IH次主力合约 (2501)	2722.8	+17.2↑
	IC主力合约 (2503)	5849.0	+0.4↑	IC次主力合约 (2501)	5889.2	-1.0↓
	IM主力合约 (2503)	6057.8	-18.4↓	IM次主力合约 (2501)	6133.6	-19.6↓
	IF-IH当月合约价差	1275.2	-4.2↓	IC-IF当月合约价差	1845.6	-14.2↓
	IM-IC当月合约价差	208.8	-11.4↓	IC-IH当月合约价差	3120.8	-18.4↓
	IM-IF当月合约价差	2054.4	-25.6↓	IM-IH当月合约价差	3329.6	-29.8↓
	IF当季-当月	4.2	+0.8↑	IF下季-当月	-20.8	+2.4↑
	IH当季-当月	5.4	-2.2↓	IH下季-当月	3	-4.6↓
	IC当季-当月	-40.2	+0.2↑	IC下季-当月	-141.2	-0.6↓
IM当季-当月	-75.8	+0.4↑	IM下季-当月	-207	+0.4↑	
期货持仓头寸 (12.27)	IF前20名净持仓	-58,733.00	+1220.0↑	IH前20名净持仓	-25,251.00	-968.0↓
	IC前20名净持仓	-18,168.00	+1834.0↑	IM前20名净持仓	-36,621.00	+1210.0↑
现货价格	沪深300	3999.05	+18.0↑	IF主力合约基差	4.3	-1.6↓
	上证50	2718.75	+17.1↑	IH主力合约基差	9.5	+0.6↑
	中证500	5898.88	-0.3↓	IC主力合约基差	-49.9	+1.9↑
	中证1000	6145.93	-25.6↓	IM主力合约基差	-88.1	+16.0↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	12,884.77	-1589.77↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	18,768.64	-86.34↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	1069.86	-262.66↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-1096.0	+981.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-439.84	-422.49	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	24.55	-41.36↓	Shibor (日, %)	1.367	-0.021↓
	IO平值看涨期权收盘价 (2501)	65.20	+2.60↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	17.31	-4.22↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2501)	62.80	-13.40↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.31	-4.22↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	12.55	-0.19↓	成交量PCR (%) (12.27)	45.30	-18.45↓
				持仓量PCR (%) (12.27)	58.26	-0.93↓
Wind市场强弱分析	全部A股	3.60	-2.60↓	技术面	2.50	-4.00↓
	资金面	4.70	-1.20↓			
行业消息	<p>1、国家统计局12月27日数据显示, 1—11月份, 全国规模以上工业企业实现利润总额66674.8亿元, 同比下降4.7%。11月份, 规模以上工业企业利润同比下降7.3%。1—11月份, 规模以上工业企业实现营业收入123.48万亿元, 同比增长1.8%; 发生营业成本105.38万亿元, 增长2.3%; 营业收入利润率为5.40%, 同比下降0.37个百分点。</p>					
观点总结	<p>A股主要指数多数上涨, 大盘股表现强于小盘股。截至收盘, 上证指数涨0.21%, 深证成指涨0.1%, 创业板指涨0.06%。沪深两市成交额仍在万亿水平, 但已有所萎缩。全市场近4000只个股下跌。板块多数下跌, 美容护理板块领涨。国内方面, 经济基本面, 11月规模以上工业企业利润当月同比降幅继续收窄, 工业企业利润持续恢复。结合此前的一系列数据, 11月国内经济基本面呈现缓慢修复态势。整体来看, 国内年底相关会议已经落地, 市场短期暂时处于政策空窗期, 市场走势呈现随机游走态势, 在更多利好政策出台前股指预计维持震荡格局, 关注周二公布的PMI数据。从长期来看, 政策对经济起到托底, 随着明年相关政策的逐步落地, 经济有望企稳回升, 并推动投资者信心回暖。策略上, 建议短线暂时观望, 中长线回调逢低布局。</p>					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

重点关注

12/30 22:45 美国12月芝加哥PMI
12/31 9:30 中国12月官方制造业、非制造业、综合PMI
1/2 9:45 中国12月财新制造业PMI
1/2 16:50 法国12月SPGI制造业PMI终值; 16:55 德国12月SPGI制造业PMI终值; 17:00 欧元区12月SPGI制造业PMI终值; 17:30 英国12月SPGI制造业PMI终值; 23:00 美国12月ISM制造业PMI
1/3 9:45 中国12月财新服务业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

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