

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(2312)	3571.6	+16.0↑	IF次主力合约(2403)	3585.8	+16.8↑
	IH主力合约(2312)	2412.6	+9.2↑	IH次主力合约(2403)	2424.8	+9.2↑
	IC主力合约(2312)	5612.4	+51.2↑	IC次主力合约(2403)	5576.2	+52.2↑
	IM主力合约(2312)	6176.6	+67.6↑	IM次主力合约(2403)	6110.4	+70.2↑
	IF-IH当月合约价差	1159.0	+11.4↑	IC-IF当月合约价差	2040.8	+38.6↑
	IM-IC当月合约价差	564.2	+22.0↑	IC-IH当月合约价差	3199.8	+50.0↑
	IM-IF当月合约价差	2605.0	+60.6↑	IM-IH当月合约价差	3764.0	+72.0↑
	IF当季-当月	14.2	-0.2↓	IF下季-当月	9.6	-2.4↓
	IH当季-当月	12.2	-0.2↓	IH下季-当月	9.2	-0.4↓
	IC当季-当月	-36.2	-1.6↓	IC下季-当月	-95.8	-2.6↓
IM当季-当月	-66.2	-4.2↓	IM下季-当月	-141.6	+8.2↑	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-58,045.00	+824.0↑	IH前20名净持仓	-28,609	+510.0↑
	IC前20名净持仓	-27,681.00	+1760.0↑	IM前20名净持仓	-18324	-344.0↓
现货价格	沪深300	3561.52	+17.1↑	IF主力合约基差	10.1	+4.2↑
	上证50	2405.17	+8.3↑	IH主力合约基差	7.4	+4.1↑
	中证500	5622.99	+50.1↑	IC主力合约基差	-10.6	-22.1↓
	中证1000	6197.53	+64.6↑	IM主力合约基差	-20.9	-40.0↓
市场情绪	A股成交额(日, 亿元)	8,396.32	-487.85↓	两融余额(前一交易日, 亿元)	16,743.08	-4.28↓
	陆股通(昨日, 今日, 亿元)	-35.39	+50.58↑	逆回购(到期量, 操作量, 亿元)	-3770	+5190↑
	主力资金(昨日, 今日, 亿元)	-455.60	-121.36↓	MLF(续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例(日, %)	78.60	+56.62↑	Shibor(日, %)	1.896	-0.003↓
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价(2312)	60.40	+8.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率(%)	13.34	-1.30↓
	IO平值看跌期权收盘价(2312)	38.60	-11.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率(%)	13.37	-3.03↓
	沪深300指数20日波动率(%)	10.60	+0.08↑	成交量PCR(%)	79.22	+2.49↑
	全部A股	7.40	+4.30↑	持仓量PCR(%)	51.33	-0.60↓
资金面	6.90	+2.90↑	技术面	7.90	+5.70↑	
行业消息	<p>1、十四届全国人大常委会第六次会议审议了央行行长潘功胜受国务院委托作的关于金融工作情况的报告，并提出具体意见和建议，包括更加精准有力实施稳健的货币政策，强化金融支持实体经济能力，高度重视防范化解金融领域风险隐患，深化金融业改革开放。有建议提出，加大对“保交楼”的金融支持力度，支持房地产企业合理融资需求，降低其信用违约的风险，缓解居民购置期房的恐慌预期；一些大型房企发生债务违约，不仅应当查找企业本身经营、管理的问题，也应当查找相关金融机构是否存在内部管理不到位、甚至腐败的问题。</p>				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	<p>A股主要指数收涨。大盘全天震荡回升，午后在北向进场加持下涨势有所扩大，三大指数集体收涨。截至收盘，沪指涨0.6%，深证成指涨0.78%，创业板指涨0.58%。四期指中，中小盘指数表现较强。沪深两市成交量延续回落，北向资金显著净流入。人民币汇率的企稳，或将助力A股年末行情的展开。随着美国通胀下行和美元指数走弱，市场继续交易“美联储加息结束”预期，全球风险资产有望迎来走升波段。国内层面上，10月各项经济数据显示国内需求端仍显不足，在“跨周期和逆周期调节”的政策基调下，财政政策靠前发力，货币政策也将配合宽松。A股流动性趋松亦对指数形成利好。策略上，中长线逢低布局多单。</p>				<p>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	<p>11-23 17:00 欧元区11月综合PMI初值 11-24 18:00 欧洲央行行长拉加德发表讲话</p>					

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