

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 (2509)	4163.8	-0.8↓	IF次主力合约 (2508)	4172.6	-2.8↓
	IH主力合约 (2509)	2829.6	+13.6↑	IH次主力合约 (2508)	2828.0	+13.0↑
	IC主力合约 (2509)	6380.2	-64.2↓	IC次主力合约 (2508)	6431.6	-72.2↓
	IM主力合约 (2509)	6929.2	-66.2↓	IM次主力合约 (2508)	6989.0	-71.8↓
	IF-IH当月合约价差	1344.6	-18.6↓	IC-IF当月合约价差	2259.0	-65.6↓
	IM-IC当月合约价差	557.4	-1.0↓	IC-IH当月合约价差	3603.6	-84.2↓
	IM-IF当月合约价差	2816.4	-66.6↓	IM-IH当月合约价差	4161.0	-85.2↓
	IF当季-当月	-33.8	+4.4↑	IF下季-当月	-59.8	+5.8↑
	IH当季-当月	1.8	-2.2↓	IH下季-当月	2.2	-4.6↓
	IC当季-当月	-188.6	+14.0↑	IC下季-当月	-307.8	+23.0↑
	IM当季-当月	-234.0	+8.2↑	IM下季-当月	-407.2	+11.0↑
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-26,185.00	-2544.0↓	IH前20名净持仓	-16,055.00	-1890.0↓
	IC前20名净持仓	-15,324.00	-2013.0↓	IM前20名净持仓	-49,157.00	-3751.0↓
现货价格	沪深300	4173.31	-3.3↓	IF主力合约基差	-9.5	-3.7↓
	上证50	2829.47	+16.5↑	IH主力合约基差	0.1	-5.7↓
	中证500	6429.85	-78.3↓	IC主力合约基差	-49.7	+6.6↑
	中证1000	6976.49	-87.9↓	IM主力合约基差	-47.3	+15.2↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	23,062.83	+1310.72↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	20,462.51	+117.18↑
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	2771.92	+406.58↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-1607.0	+1287.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-70.99	-990.56↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	13.54	-36.85↓	Shibor (日, %)	1.315	0.000
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价 (2508)	24.60	-11.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	10.40	-1.05↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2508)	3.60	-3.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	10.40	-1.55↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	9.78	-0.11↓	成交量PCR (%)	55.40	+1.48↑
				持仓量PCR (%)	86.90	+6.51↑
行业消息	全部A股	2.70	-3.40↓	技术面	1.40	-3.60↓
	资金面	4.10	-3.10↓			
观点总结	1、国家统计局发布数据显示，7月CPI环比由上月下降0.1%转为上涨0.4%，同比持平，扣除食品和能源价格的核心CPI同比上涨0.8%，涨幅连续3个月扩大。7月PPI环比下降0.2%，环比降幅比上月收窄0.2个百分点，同比下降3.6%，降幅与上月相同。2、据央行统计，今年前七个月，社会融资规模增量累计为23.99万亿元，比上年同期多5.12万亿元；人民币贷款增加12.87万亿元。7月末，M2同比增长8.8%，M1增长5.6%，社会融资规模存量增长9%。					



更多观点请咨询！



更多资讯请关注！

8/14 20:30 美国7月PPI、核心PPI

8/15 10:00 中国7月规模以上工业增加值、固定资产投资、社会消费品零售总额、房地产数据

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。

