

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)	4621.0	+58.4↑	IF次主力合约 (2608)	4646.0	+60.4↑
	IH主力合约 (2609)	2893.4	+38.6↑	IH次主力合约 (2608)	2911.0	+39.4↑
	IC主力合约 (2609)	7744.4	+196.0↑	IC次主力合约 (2608)	7784.6	+197.2↑
	IM主力合约 (2609)	7433.8	+204.0↑	IM次主力合约 (2608)	7479.2	+209.6↑
	IF-IH当月合约价差	1735.0	+25.0↑	IC-IF当月合约价差	3138.6	+143.4↑
	IM-IC当月合约价差	-305.4	+12.4↑	IC-IH当月合约价差	4873.6	+168.4↑
	IM-IF当月合约价差	2833.2	+155.8↑	IM-IH当月合约价差	4568.2	+180.8↑
	IF当季-当月	-98.8	-4.0↓	IF下季-当月	-168.2	-0.6↓
	IH当季-当月	-53.8	-3.2↓	IH下季-当月	-76.8	-4.6↓
	IC当季-当月	-187.6	+1.4↑	IC下季-当月	-339.8	+1.0↑
	IM当季-当月	-210.2	-3.0↓	IM下季-当月	-379.2	-7.6↓
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	32,195.00	-346.0↓	IH前20名净持仓	21,912.00	+6.0↑
	IC前20名净持仓	33,216.00	-415.0↓	IM前20名净持仓	72,597.00	-148.0↓
现货价格	沪深300	4658.15	+57.2↑	IF主力合约基差	-37.2	+11.0↑
	上证50	2,924.1	+45.4↑	IH主力合约基差	-30.7	-4.4↓
	中证500	7,809.2	+201.7↑	IC主力合约基差	-64.8	+13.7↑
	中证1000	7,493.1	+213.9↑	IM主力合约基差	-59.3	+8.5↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	26,798.86	+4514.45↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	26,152.21	+126.95↑
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	2963.58	-13.63↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-5065.0	+5050.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+585.49	+504.70	MLF (到期量, 投放量, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	67.34	+1.57↑	Shibor (日, %)	1.360	-0.006↓
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2608)	71.80	+21.80↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	18.19	-0.46↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2608)	78.40	-40.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.19	-0.67↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	28.89	+0.35↑	成交量PCR (%)	62.92	+13.23↑
				持仓量PCR (%)	70.61	+2.12↑
行业消息	1、7月31日, 国家统计局发布数据显示, 7月份, 制造业PMI、非制造业PMI和综合PMI分别为49.2%、49.0%和49.3%, 比上月下降1.1个、1.2个和1.3个百分点。 2、美国财政部长贝森特称, 美国可能于8月5日与伊朗达成协议以开放霍尔木兹海峡。美国国务卿鲁比奥表示, 与伊朗就重新开放霍尔木兹海峡进行的谈判“已经取得进展”, 但协议尚未最终敲定, 希望协议“很快能够达成”。 3、伊朗已放弃此前要求对霍尔木兹海峡双向航运实施全面控制的立场。伊朗政府在考虑允许欧洲国家参与霍尔木兹海峡扫雷行动, 这正是此前谈判中伊朗始终拒绝让步的核心议题之一。伊朗外交部发言人巴加埃表示, 伊朗仍在与阿曼就霍尔木兹海峡进行谈判, 谈判在技术和政治层面取得“积极进展”。					 更多观点请咨询!
观点总结	A股主要指数收盘集体上涨, 三大指数低开高走。截止收盘, 上证指数涨1.47%, 深证成指涨1.86%, 创业板指涨1.32%。沪深两市成交额明显回升。中小盘股强于大盘蓝筹股。全市场超3700只个股上涨。行业板块普遍上涨, 电子、有色金属板块大幅走强, 通信、银行板块领跌。海外方面, 地缘局势上, 美国国务卿鲁比奥及财政部长贝森特均表示将在近期就霍尔木兹海峡开放达成协议。同时, 伊朗方面已放弃此前要求对霍尔木兹海峡双向航运实施全面控制的立场。美伊谈判取得重大进展, 美油、布油双双跌破80美元, 10年期美债收益率亦降至4.6%附近。国内方面, 经济基本面, 7月份, 我国三大PMI指数全线回落至收缩区间, 作为新质生产力代表的高技术制造业与装备制造业PMI虽仍在扩张区间, 但同样出现下滑。政策面, 7月政治局会议将扩内需摆在下半年经济工作的首要位置, 同时强调财政与货币政策的配合。整体来看, 国内经济领先指标跌破荣枯线, 对股市有负面影响, 但新质生产力相关指标景气度仍较高。同时政治局会议在产业政策上的安排依旧侧重新质生产力, 且宏观政策之间相互配合的定调也为股市营造相对宽松的金融环境。伊朗方面就海峡通航问题做出巨大让步, 使得冲突有趋向结束的可能, 待外部风险因素消退后, A股有望打破震荡态势。					 更多资讯请关注!

重点关注	8/5 20:15 美国7月ADP就业人数 8/7 20:30 美国7月非农就业人数、失业率、劳动参与率 8/9 9:30 中国7月CPI、PPI 待定 中国7月贸易数据
------	--

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