

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 (2512)	4555.4	+48.6↑	IF次主力合约 (2603)	4518.2	+46.0↑
	IH主力合约 (2512)	2986.4	+22.6↑	IH次主力合约 (2603)	2978.4	+20.2↑
	IC主力合约 (2512)	7031.6	+61.4↑	IC次主力合约 (2603)	6857.8	+59.0↑
	IM主力合约 (2512)	7290.0	+40.2↑	IM次主力合约 (2603)	7057.6	+40.4↑
	IF-IH当月合约价差	1569.0	+26.4↑	IC-IF当月合约价差	2476.2	+7.8↑
	IM-IC当月合约价差	258.4	-28.2↓	IC-IH当月合约价差	4045.2	+34.2↑
	IM-IF当月合约价差	2734.6	-20.4↓	IM-IH当月合约价差	4303.6	+6.0↑
	IF当季-当月	-37.2	-3.8↓	IF下季-当月	-86.4	-5.0↓
	IH当季-当月	-8.0	-3.8↓	IH下季-当月	-19.6	-3.8↓
	IC当季-当月	-173.8	-0.6↓	IC下季-当月	-385.6	-3.4↓
	IM当季-当月	-232.4	+2.4↑	IM下季-当月	-476.8	-3.2↓
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-22,413.00	-1477.0↓	IH前20名净持仓	-12,044.00	-406.0↓
	IC前20名净持仓	-23,810.00	+686.0↑	IM前20名净持仓	-39,487.00	+1089.0↑
现货价格	沪深300	4576.49	+49.8↑	IF主力合约基差	-21.1	-0.2↓
	上证50	2,993.7	+24.1↑	IH主力合约基差	-7.3	-0.9↓
	中证500	7,101.8	+70.3↑	IC主力合约基差	-70.2	-12.9↓
	中证1000	7,386.7	+52.5↑	IM主力合约基差	-96.7	-23.3↓
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	18,894.49	+2917.18↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	24,735.77	+15.32↑
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	1863.53	-61.90↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-3387.0	+1076.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+79.88	-31.25↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	62.33	-13.33↓	Shibor (日, %)	1.307	+0.006↑
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价 (2512)	36.20	+11.20↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	12.67	-0.67↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2512)	80.20	-37.40↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	12.63	-0.84↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.94	+0.56↑	成交量PCR (%)	60.78	-3.76↓
	全部A股	6.70	-0.60↓	持仓量PCR (%)	74.09	+4.24↑
行业消息	资金面	7.10	+0.10↑	技术面	6.20	-1.30↓
	1、国家统计局发布数据显示, 11月份我国制造业PMI为49.2%, 比上月上升0.2个百分点; 非制造业PMI为49.5%, 比上月下降0.6个百分点; 综合PMI产出指数为49.7%, 比上月下降0.3个百分点。					
观点总结						
	A股主要指数收盘全线上涨。三大指数高开高走, 上证指数重回3900点上方。截止收盘, 上证指数涨0.65%, 深证成指涨1.25%, 创业板指涨1.31%。沪深两市成交额明显回升。行业板块普遍上涨, 有色金属、通信板块大幅走强, 仅农林牧渔、环保房地产板块逆市小幅走弱。国内方面, 经济基本面, 11月份我国三大PMI指数中, 非制造业PMI与综合PMI均较10月回落, 仅制造业PMI小幅回升, 三大PMI指数均处于收缩区间, 经济整体景气水平回落对市场形成一定压力。整体来看, 11月国内三大PMI均处于收缩区间, 尤其是制造业PMI已连续8个月处于收缩区间, 对市场情绪或将产生一定负面影响。进入12月上旬, 市场短期仍将处于宏观数据、业绩、政策多重真空期, 在缺乏明确交易指引的环境下, 市场预计还将保持随机游走的态势, 股指将维持震荡。					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

重点关注

- 12/1 22:45-23:00 美国11月标普全球制造业PMI初值、ISM制造业PMI  
12/2 18:00 欧元区11月HCPI、核心HCPI、失业率  
12/3 21:15 美国11月ADP就业人数  
12/4 20:30 美国11月挑战者企业裁员人数；21:30 美国11月29日当周首次申请失业救济人数  
12/5 23:00 美国11月PCE、核心PCE

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。

瑞达研究