

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)	4699.0	+76.2↑	IF次主力合约 (2608)	4729.4	+77.0↑
	IH主力合约 (2609)	2919.2	+28.8↑	IH次主力合约 (2608)	2937.2	+27.6↑
	IC主力合约 (2609)	8082.0	+208.6↑	IC次主力合约 (2608)	8161.0	+211.2↑
	IM主力合约 (2609)	7875.0	+210.0↑	IM次主力合约 (2608)	7955.6	+215.0↑
	IF-IH当月合约价差	1792.2	+52.4↑	IC-IF当月合约价差	3431.6	+140.2↑
	IM-IC当月合约价差	-205.4	+3.6↑	IC-IH当月合约价差	5223.8	+192.6↑
	IM-IF当月合约价差	3226.2	+143.8↑	IM-IH当月合约价差	5018.4	+196.2↑
	IF当季-当月	-113.4	-4.0↓	IF下季-当月	-185.6	-3.2↓
	IH当季-当月	-63.6	-3.2↓	IH下季-当月	-95.4	-9.8↓
	IC当季-当月	-283.0	-23.4↓	IC下季-当月	-461	-29.2↓
	IM当季-当月	-297.8	-9.4↓	IM下季-当月	-503.6	-18.4↓
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	30,723.00	-1646.0↓	IH前20名净持仓	18,717.00	+299.0↑
	IC前20名净持仓	30,583.00	+1268.0↑	IM前20名净持仓	58,711.00	-311.0↓
现货价格	沪深300	4741.10	+75.2↑	IF主力合约基差	-42.1	+3.4↑
	上证50	2,945.4	+29.3↑	IH主力合约基差	-26.2	-0.1↓
	中证500	8,184.6	+194.3↑	IC主力合约基差	-102.6	+26.5↑
	中证1000	7,968.4	+198.6↑	IM主力合约基差	-93.4	+26.2↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	24,025.12	+2459.36↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	26,738.59	-18.59↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	2744.69	-403.04↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-3670.0	+5655.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-129.88	+494.70↑	MLF (到期量, 投放量, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	78.19	+34.86↑	Shibor (日, %)	1.362	-0.001↓
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2608)	24.80	+16.60↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	13.72	-0.94↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2608)	43.60	-62.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	13.72	-0.20↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	20.39	+0.07↑	成交量PCR (%)	65.31	-7.54↓
				持仓量PCR (%)	79.47	+4.99↑
行业消息	1、国家统计局数据显示, 7月规模以上工业增加值同比增长4.5%, 前值增长5.3%; 1-7月累计同比增长5.3%。1-7月固定资产投资同比下降6.7%, 前值下降5.7%。基础设施投资同比下降3.6%, 制造业投资下降1.7%, 房地产开发投资下降19.2%。7月社会消费品零售总额同比增长0.6%, 前值增长1%; 1-7月累计同比增长1.2%。7月全国调查失业率5.2%, 前值5%。 2、据央行统计, 今年前七个月, 人民币贷款增加10.38万亿元; 社会融资规模增量累计为22.25万亿元, 比上年同期少1.74万亿元。7月末, M2余额同比增长7.7%; 社会融资规模存量为463.27万亿元, 同比增长7.4%。					 更多观点请咨询!
观点总结	A股主要指数收盘集体大幅上涨, 三大指数高开高走。截止收盘, 上证指数涨1.41%, 深证成指涨2.44%, 创业板指涨3.14%。沪深两市成交额大幅回升。中小盘股强于大盘蓝筹股。全市场超4300只个股上涨。行业板块普遍上涨, 电子、通信板块大幅走弱, 食品饮料板块领跌。海外方面, 经济数据上, 美国7月零售销售环比增速明显弱于市场预期录得大幅下降, 加上此前CPI、PPI同比增速均明显回落, 市场对于美联储9月会议加息的预期降至33%。地缘局势上, 美伊谅解备忘录将于8月17日到期, 目前几乎没有达成最终协议的迹象。同时伊朗方面表态依旧强硬。国内方面, 经济基本面, 7月份, 我国进出口、规上工业增加值、固投、社零多项指标集体回落, 投资端尤为疲弱, 但值得注意的是高技术产业的生产、投资、出口增速较6月呈现上升。资金面, 7月金融数据显示, A股市值与住户存款比值出现回落, 同时居民存款与M2负剪刀差进一步收敛。上市公司基本面, 已披露半年报的部分公司业绩表现良好, 中证500指数净利增速超60%。整体来看, 美伊冲突仍未解决, 原油与美债收益率仍在关键点位上方, 市场压力尚未缓解。同时, 宏观基本面对股市带来的压力依旧明显, 高科技产业与传统产业分化持续。最后, 上市公司盈利目前呈现高增速, 但由于数量较少, 且业绩好的公司通常率先披露, 因此, 半年报的整体情况仍有待观察。					 更多资讯请关注!

重点关注	8/20 2:00 美联储7月会议纪要
	8/20 9:00 中国8月1年期、5年期LPR报价
	8/21 15:15-16:30 法国、德国、欧元区、英国8月标普全球制造业、服务业、综合PMI；21:45 美国8月标普全球制造业、服务业、综合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