

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)	4530.6	+17.2↑	IF次主力合约 (2603)	4492.2	+15.4↑
	IH主力合约 (2512)	2968.2	+13.0↑	IH次主力合约 (2603)	2958.6	+10.8↑
	IC主力合约 (2512)	6983.2	+42.0↑	IC次主力合约 (2603)	6812.2	+40.2↑
	IM主力合约 (2512)	7213.4	+28.0↑	IM次主力合约 (2603)	6987.8	+26.6↑
	IF-IH当月合约价差	1562.4	+2.6↑	IC-IF当月合约价差	2452.6	+20.4↑
	IM-IC当月合约价差	230.2	-14.8↓	IC-IH当月合约价差	4015.0	+23.0↑
	IM-IF当月合约价差	2682.8	+5.6↑	IM-IH当月合约价差	4245.2	+8.2↑
	IF当季-当月	-38.4	-2.6↓	IF下季-当月	-89	-4.6↓
	IH当季-当月	-9.6	-2.4↓	IH下季-当月	-24.4	-3.0↓
	IC当季-当月	-171.0	-2.0↓	IC下季-当月	-378.2	-0.4↓
	IM当季-当月	-225.6	+1.6↑	IM下季-当月	-465.2	-0.8↓
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-19,498.00	-175.0↓	IH前20名净持仓	-11,870.00	+487.0↑
	IC前20名净持仓	-21,167.00	+182.0↑	IM前20名净持仓	-33,240.00	-1242.0↓
现货价格	沪深300	4546.57	+15.5↑	IF主力合约基差	-16.0	-3.1↓
	上证50	2,974.3	+11.3↑	IH主力合约基差	-6.1	-1.5↓
	中证500	7,012.8	+16.5↑	IC主力合约基差	-29.6	+16.3↑
	中证1000	7,248.7	+0.4↑	IM主力合约基差	-35.3	+17.6↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	15,616.65	-1218.9↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	24,825.92	-38.6↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	1873.09	+75.49↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-3564.0	+1808.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-686.96	-321.57↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	26.67	+0.22↑	Shibor (日, %)	1.302	+0.001↑
	IO平值看涨期权收盘价 (2512)	40.60	+3.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	12.72	0.00
	IO平值看跌期权收盘价 (2512)	58.40	-8.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	12.72	+0.24↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	13.89	-0.97↓	成交量PCR (%)	60.61	-13.68↓
				持仓量PCR (%)	73.71	+0.39↑
Wind市场强弱分析	全部A股	3.80	+0.40↑	技术面	2.70	+0.10↑
	资金面	5.00	+0.80↑			
行业消息	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。 2、美国11月ADP就业数据显示, 11月私营企业减少3.2万个工作岗位, 为2023年3月以来最大降幅, 远不及市场预期的增加1万个。					
	 更多观点请咨询!					
观点总结	A股主要指数收盘普遍上涨。三大指数早盘集体高开并呈现宽幅震荡, 午后波动收敛。大盘蓝筹股强于中小盘股。截止收盘, 上证指数跌0.06%, 深证成指涨0.4%, 创业板指涨1.01%。沪深两市成交额明显回落。全市场近3900只个股下跌。行业板块普遍下跌, 综合、美容护理板块跌幅居前, 机械设备、电子板块领涨。海外方面, 美国11月小非农明显走弱, 支撑美联储12月降息预期。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。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。					
	 更多资讯请关注!					

重点关注	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