

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(2312)	3523.2	+9.2↑	IF次主力合约(2403)	3533.6	+7.8↑
	IH主力合约(2312)	2375.0	+3.4↑	IH次主力合约(2403)	2385.6	+3.2↑
	IC主力合约(2312)	5561.8	+20.8↑	IC次主力合约(2403)	5523.8	+20.6↑
	IM主力合约(2312)	6097.2	+24.6↑	IM次主力合约(2403)	6017.8	+24.6↑
	IF-IH当月合约价差	1148.2	+4.8↑	IC-IF当月合约价差	2038.6	+9.4↑
	IM-IC当月合约价差	535.4	+0.6↑	IC-IH当月合约价差	3186.8	+14.2↑
	IM-IF当月合约价差	2574.0	+10.0↑	IM-IH当月合约价差	3722.2	+14.8↑
	IF当季-当月	10.4	-1.8↓	IF下季-当月	7.6	-0.8↓
	IH当季-当月	10.6	-1.2↓	IH下季-当月	9.6	+0.2↑
	IC当季-当月	-38.0	+0.8↑	IC下季-当月	-104.6	-5.0↓
IM当季-当月	-79.4	-3.0↓	IM下季-当月	-165.8	-5.6↓	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-58,230.00	+1241.0↑	IH前20名净持仓	-28,013	+824.0↑
	IC前20名净持仓	-25,835.00	+636.0↑	IM前20名净持仓	-17445	+444.0↑
现货价格	沪深300	3518.52	+6.6↑	IF主力合约基差	4.7	+5.3↑
	上证50	2371.21	+0.5↑	IH主力合约基差	3.8	+3.1↑
	中证500	5591.50	+25.0↑	IC主力合约基差	-29.7	-20.1↓
	中证1000	6143.30	+31.9↑	IM主力合约基差	-46.1	-30.2↓
市场情绪	A股成交额(日, 亿元)	7,953.31	-605.10↓	两融余额(前一交易日, 亿元)	16,721.67	+14.82↑
	陆股通(昨日, 今日, 亿元)	+3.41	+28.34↑	逆回购(到期量, 操作量, 亿元)	-3190	+4150
	主力资金(昨日, 今日, 亿元)	-259.12	-219.08↓	MLF(续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例(日, %)	69.93	+22.02↑	Shibor(日, %)	1.711	-0.098↓
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价(2312)	57.00	+1.80↑	IO平值看涨期权隐含波动率(%)	13.52	+2.82↑
	IO平值看跌期权收盘价(2312)	31.40	-6.40↓	IO平值看跌期权隐含波动率(%)	13.79	+4.01↑
	沪深300指数20日波动率(%)	9.74	+0.01↑	成交量PCR(%)	80.95	+9.35↑
	全部A股	6.80	+2.20↑	持仓量PCR(%)	48.00	-1.53↓
资金面	6.50	+2.10↑	技术面	7.00	+2.20↑	
行业消息	1、央行发布第三季度中国货币政策执行报告指出，坚持把金融服务实体经济作为根本宗旨，建设现代中央银行制度，始终保持货币政策的稳健性，加强优质金融服务，更好支持扩大内需，促进稳外资稳外贸，为经济社会发展提供高质量服务。				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数收涨。大盘低开后震荡回升，下午盘再度极窄震荡。截至收盘，沪指涨0.23%，深证成指涨0.49%，创业板指涨0.63%。四期指中，中小盘指数表现相对较弱。沪深两市成交量小回落，北向资金呈净买入。近期A股的上行动能多由汇率升值拉升，而影响人民币升值预期的美债利率在本月已较大程度释放了下行压力，因此，对于年末推升A股的动力或边际减弱。目前，市场仍旧期待年底政策预期，若宽货币以及宽财政等预期兑现，市场上涨动力或将有所增加。短期内上涨动力或环比减弱，维持谨慎乐观的态度。策略上，中长线逢低布局多单。				<p>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	11-29 21:30 美国三季度实际GDP年化季环比修正值 11-30 09:30 中国11月官方制造业PMI 12-1 09:45 中国11月财新制造业PMI; 23:00 美国11月ISM制造业指数					

蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101

助理研究员：

廖宏斌 期货从业资格号F3082507

王世霖 期货从业资格号F03118150

曾奕蓉 期货从业资格号F03105260

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