

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 (2311)	3585.6	-2.8↓	IF次主力合约 (2312)	3609.2	-2.2↓
	IH主力合约 (2311)	2411.6	-4.4↓	IH次主力合约 (2312)	2432.6	-4.4↓
	IC主力合约 (2311)	5590.6	+29.4↑	IC次主力合约 (2312)	5548.2	+17.6↑
	IM主力合约 (2311)	6124.0	+58.8↑	IM次主力合约 (2312)	6039.6	+40.2↑
	IF-IH当月合约价差	1174.0	+2.8↑	IC-IF当月合约价差	2005.0	+31.6↑
	IM-IC当月合约价差	533.4	+28.6↑	IC-IH当月合约价差	3179.0	+34.4↑
	IM-IF当月合约价差	2538.4	+60.2↑	IM-IH当月合约价差	3712.4	+63.0↑
	IF当季-当月	23.6	-0.6↓	IF下季-当月	20.6	-2.4↓
	IH当季-当月	21.0	+1.0↑	IH下季-当月	16.8	+0.8↑
	IC当季-当月	-42.4	-14.2↓	IC下季-当月	-89.4	-15.8↓
IM当季-当月	-84.4	-21.2↓	IM下季-当月	-145	-26.0↓	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-64,241.00	-1131.0↓	IH前20名净持仓	-31,573	+1150.0↑
	IC前20名净持仓	-28,190.00	-75.0↓	IM前20名净持仓	-20393	+1361.0↑
现货价格	沪深300	3579.41	-7.1↓	IF主力合约基差	6.2	+1.3↑
	上证50	2407.59	-6.4↓	IH主力合约基差	4.0	+2.6↑
	中证500	5605.57	+32.5↑	IC主力合约基差	-15.0	-11.9↓
	中证1000	6144.63	+56.1↑	IM主力合约基差	-20.6	-22.6↓
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	8,706.87	+409.83↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,501.00	-4.90↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-48.64	-14.43↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-180	+1130
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-298.21	-119.45↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	73.53	+33.53↑	Shibor (日, %)	1.754	+0.053↑
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价 (2311)	19.60	-5.00↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	14.14	-1.88↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2311)	33.40	-1.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	13.97	-2.36↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	13.13	-0.41↓	成交量PCR (%)	72.10	-5.82↓
	全部A股	6.90	+2.70↑	持仓量PCR (%)	62.28	-0.68↓
资金面	6.50	+2.20↑	技术面	7.40	+3.40↑	
行业消息	<p>1、11月9日, 国家统计局发布10月份通胀数据: 从环比看, CPI下降0.1%。其中, 食品价格由上月上涨0.3%转为下降0.8%, 影响CPI下降约0.14个百分点。从同比看, CPI下降0.2%。其中, 食品价格下降4.0%, 降幅比上月扩大0.8个百分点, 影响CPI下降约0.75个百分点。从环比看, 全国PPI由上月上涨0.4%转为持平。其中, 生产资料价格上涨0.1%, 涨幅比上月回落0.4个百分点; 生活资料价格由上月上涨0.1%转为下降0.1%。</p>				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	<p>A股主要指数震荡整理。大盘在早间弱势震荡后, 下午盘指数层面翻红, 随后横盘整理。截至收盘, 沪指涨0.25%, 深证成指涨0.1%, 创业板指涨0.2%。四期指小盘指数走势偏强。沪深两市成交量再度回落, 北向资金小幅净流出。国内经济逐季修复趋势较为明确, 虽然10月经济数据小幅走弱, 然增量政策的效果将逐步显现, 市场预期后续政策降息概率提升。海外层面上, 12月美联储再度加息概率较小, APEC会议期间中美元首会晤即将进行, 外部环境以及地缘政治情绪的改善有助于提振A股市场风险整体偏好。未见得新的利好因素之前, 短线指数或趋于震荡, 静待资金情绪整体回暖。策略上, 中长线上可考虑逢低做多。</p>				<p>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	<p>11-14 10: 00 美国财政耶伦举行新闻发布会; 21: 30 美国10月核心CPI同比; 美国10月CPI同比 11-15 10: 00 中国1至10月全国房地产开发投资; 中国1至10月社会消费品零售总额同比; 中国1至10月规模以上工业增加值同比 11-16 19: 30 欧央行行长拉加德发表讲话</p>					

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