

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)	3585.0	+5.6↑	IF次主力合约 (2312)	3609.8	+7.0↑
	IH主力合约 (2311)	2410.0	+1.6↑	IH次主力合约 (2312)	2431.4	+2.4↑
	IC主力合约 (2311)	5616.6	+33.4↑	IC次主力合约 (2312)	5565.2	+25.0↑
	IM主力合约 (2311)	6165.4	+54.4↑	IM次主力合约 (2312)	6061.6	+34.4↑
	IF-IH当月合约价差	1175.0	+1.0↑	IC-IF当月合约价差	2031.6	+26.6↑
	IM-IC当月合约价差	548.8	+15.4↑	IC-IH当月合约价差	3206.6	+27.6↑
	IM-IF当月合约价差	2580.4	+42.0↑	IM-IH当月合约价差	3755.4	+43.0↑
	IF当季-当月	24.8	+1.2↑	IF下季-当月	25.4	+4.8↑
	IH当季-当月	21.4	+0.4↑	IH下季-当月	17.6	+0.8↑
	IC当季-当月	-51.4	-9.0↓	IC下季-当月	-98.4	-9.0↓
IM当季-当月	-103.8	-19.4↓	IM下季-当月	-167.2	-22.2↓	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-62,596.00	+1645.0↑	IH前20名净持仓	-31,987	-414.0↓
	IC前20名净持仓	-27,003.00	+1187.0↑	IM前20名净持仓	-17847	+2546.0↑
现货价格	沪深300	3582.06	+2.6↑	IF主力合约基差	2.9	+6.2↑
	上证50	2406.40	-1.2↓	IH主力合约基差	3.6	+4.0↑
	中证500	5630.55	+25.0↑	IC主力合约基差	-13.9	-15.0↓
	中证1000	6181.98	+37.3↑	IM主力合约基差	-16.6	-20.6↓
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	8,961.08	+254.21↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,558.24	+57.24↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-14.43	-21.09	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-3530	+4240
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-119.45	-114.00	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	56.39	-17.14↓	Shibor (日, %)	1.913	+0.159↑
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价 (2311)	17.80	-1.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	14.66	+3.68↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2311)	29.80	-3.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	14.53	+4.02↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	13.05	-0.08↓	成交量PCR (%)	65.31	-6.90↓
	全部A股	6.10	-0.80↓	持仓量PCR (%)	62.38	+0.28↑
资金面	6.50	0.00	技术面	5.60	-1.80↓	
行业消息	1、央行11月13日公布2023年10月金融数据, 中国10月M2同比增长10.3%, 预期10.5%, 前值10.3%。中国10月新增人民币贷款7384亿元, 预期6400亿元, 前值2.31万亿元。中国10月社会融资规模增量为1.85万亿元, 预期1.82万亿元, 前值4.12万亿元。				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数涨跌不一。大盘延续横盘窄震格局, 沪指日内振幅创近期新低。截至收盘, 沪指涨0.31%, 深证成指涨0.17%, 创业板指跌0.22%。四期指小盘指数走势偏强。沪深两市成交活跃度未见明显提升, 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>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	11-14 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					

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