

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(2402)	3171.2	+17.0↑	IF次主力合约(2403)	3098.0	-18.8↓
	IH主力合约(2402)	2240.0	+22.6↑	IH次主力合约(2403)	2219.4	+15.6↑
	IC主力合约(2402)	4380.0	-104.2↓	IC次主力合约(2403)	4154.0	-158.4↓
	IM主力合约(2402)	4176.6	-304.4↓	IM次主力合约(2403)	3922.6	-372.0↓
	IF-IH当月合约价差	931.2	-12.2↓	IC-IF当月合约价差	1208.8	-138.6↓
	IM-IC当月合约价差	-203.4	-197.8↓	IC-IH当月合约价差	2140.0	-150.8↓
	IM-IF当月合约价差	1005.4	-336.4↓	IM-IH当月合约价差	1936.6	-348.6↓
	IF当季-当月	-73.2	-38.0↓	IF下季-当月	-107.6	-42.0↓
	IH当季-当月	-20.6	-10.4↓	IH下季-当月	-58.8	-15.6↓
	IC当季-当月	-226.0	-52.0↓	IC下季-当月	-298.6	-63.8↓
IM当季-当月	-254.0	-69.8↓	IM下季-当月	-326.6	-57.4↓	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-54,079.00	-3225.0↓	IH前20名净持仓	-30,148	-533.0↓
	IC前20名净持仓	-23,983.00	+19.0↑	IM前20名净持仓	-37905	+270.0↑
现货价格	沪深300	3200.42	+20.8↑	IF主力合约基差	-29.2	-14.2↓
	上证50	2255.28	+26.3↑	IH主力合约基差	-15.3	-7.0↓
	中证500	4460.26	-103.0↓	IC主力合约基差	-80.3	-50.4↓
	中证1000	4293.07	-281.6↓	IM主力合约基差	-116.5	-67.5↓
市场情绪	A股成交额(日, 亿元)	8,849.52	+708.41↑	两融余额(前一交易日, 亿元)	15,236.41	-427.21↓
	陆股通(昨日, 今日, 亿元)	+23.61	+12.11	逆回购(到期量, 操作量, 亿元)	-5000	+1000
	主力资金(昨日, 今日, 亿元)	-418.03	-302.82	MLF(续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例(日, %)	8.41	+1.15↑	Shibor(日, %)	1.680	+0.004↑
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价(2402)	43.00	+2.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率(%)	34.19	+11.29↑
	IO平值看跌期权收盘价(2402)	71.40	-2.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率(%)	34.50	+13.97↑
	沪深300指数20日波动率(%)	17.35	+0.11↑	成交量PCR(%)	163.07	+42.10↑
	全部A股	2.10	0.00	持仓量PCR(%)	46.81	+2.29↑
资金面	3.40	0.00	技术面	0.80	+0.10↑	
行业消息	1、2月1日公布的2024年1月财新中国制造业采购经理指数(PMI)录得50.8, 与上月持平。自2021年6月以来, 该指数首次连续三个月位于扩张区间。					
观点总结	<p>A股主要指数回调。A股低开低走, 沪指失守2700点盘中下挫超3%, 深证成指、创业板指一度跌逾4%, 三大指数均刷新阶段新低。截至收盘, 沪指跌1.02%, 深证成指跌1.13%, 创业板指涨0.79%。四期指均收跌, 中小股指表现更弱。沪深两市成交量放大, 北向资金连续净流入。A股市场近期陷入资金负反馈的过程中, 国内经济基本面以及外部因素扰动有一定影响, 然而目前资金交易恶化或是主因。当前股权质押市场风险总体可控, 虽尚未触发, 但需要密切关注后续市场深度回调的风险。基本上, 政策及经济实质性增长是稳定信心的关键, 2月或成为重要观察期。策略上, 随着市场步入低位, IC/IM维持贴水格局, 建议多近空远跨期套利。短线策略或可考虑跨品种价差持有, 多IF空IM为主。</p>					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

重点关注

2-5 23: 00 美国1月ISM非制造业指数
2-7 01: 00 2024年FOMC票委、克利夫兰联储主席梅斯特发表讲话
2-8 01: 30 2024年FOMC票委、里奇蒙德联储主席巴尔金发表讲话; 09: 30 中国1月CPI同比; 中国1月PPI同比; 2024年FOMC票委、里奇蒙德联储主席巴尔金接受彭博电视台的采访

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3

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