一、指数走势

11 月 17 日，上证综指涨跌幅-0.5%，收于 3584.58 点，成交额 6905.15 亿元，深成指数涨跌幅-0.49%，收于 10638.52 点，成交额 7671.8 亿元。

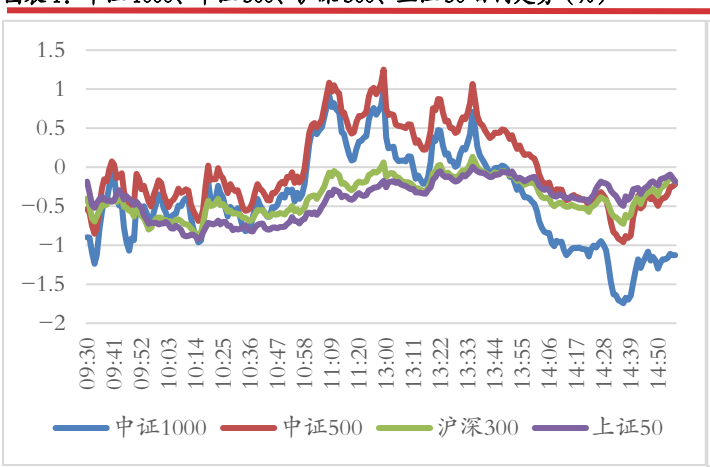
中证 1000 指数涨跌幅-1.17%，成交额 2832.13 亿元，其中开盘价 6111.05，收盘价 6092.39，当日最高价 6225.56，最低价 6055.73；

中证 500 指数涨跌幅-0.23%，成交额 2593.36 亿元，其中开盘价 6252.19，收盘价 6283.01，当日最高价 6376.51，最低价 6234.4；

沪深 300 指数涨跌幅-0.08%，成交额 4094.77 亿元，其中开盘价 3965.9，收盘价 3976.46，当日最高价 3985.99，最低价 3942.38；

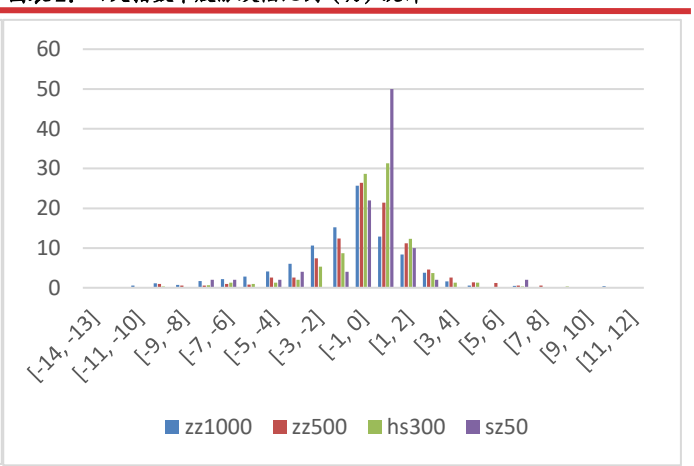
上证 50 指数涨跌幅 0.06%，成交额 1230.98 亿元，其中开盘价 2764.63，收盘价 2768.36，当日最高价 2768.36，最低价 2739.54。

图表 1：中证 1000、中证 500、沪深 300、上证 50 日内走势（%）



数据来源：Wind，光期研究所

图表 2：四大指数个股涨跌幅比例（%）统计



数据来源：Wind，光期研究所

二、板块涨跌对指数影响

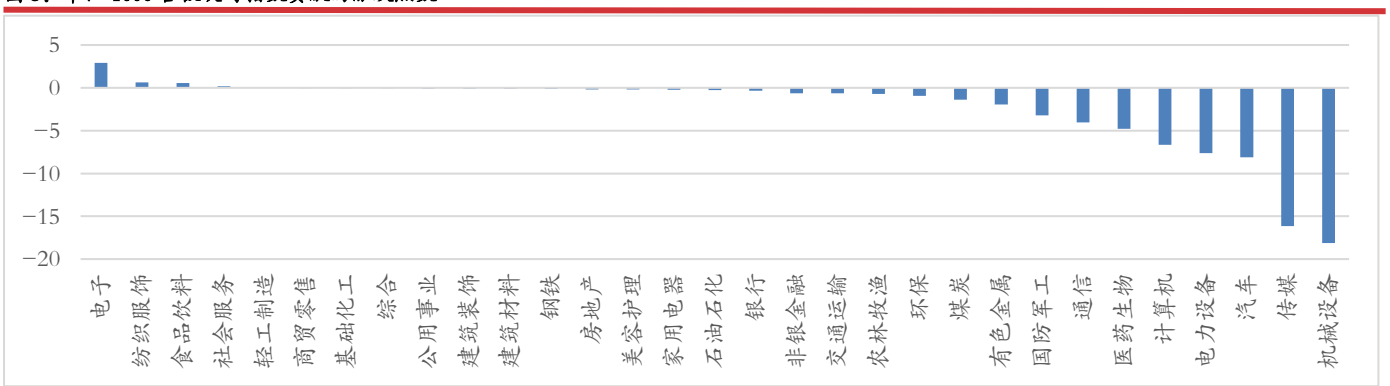
中证 1000 较前收盘价上涨-72.23 点，汽车,传媒,机械设备等板块对指数向下拉动明显。

中证 500 较前收盘价上涨-14.17 点，电子,基础化工,家用电器等板块对指数向上拉动明显，通信,汽车,传媒等板块对指数向下拉动明显。

沪深 300 较前收盘价上涨-3.34 点，银行,食品饮料,家用电器等板块对指数向上拉动明显，机械设备,电力设备,通信等板块对指数向下拉动明显。

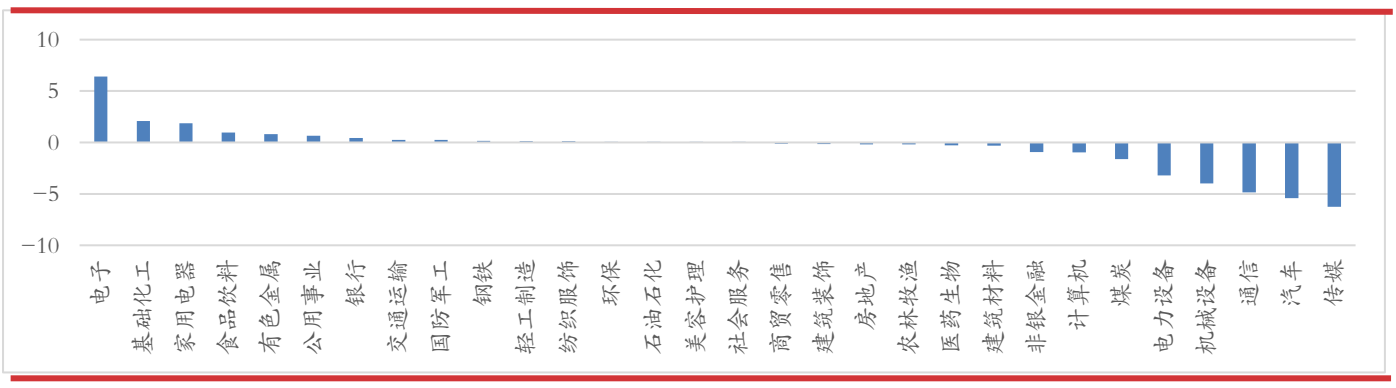
上证 50 较前收盘价上涨 1.79 点，食品饮料,非银金融,银行等板块对指数向上拉动明显，机械设备,电子,有色金属等板块对指数向下拉动明显。

图 3：中证 1000 各板块对指数贡献的涨跌点数



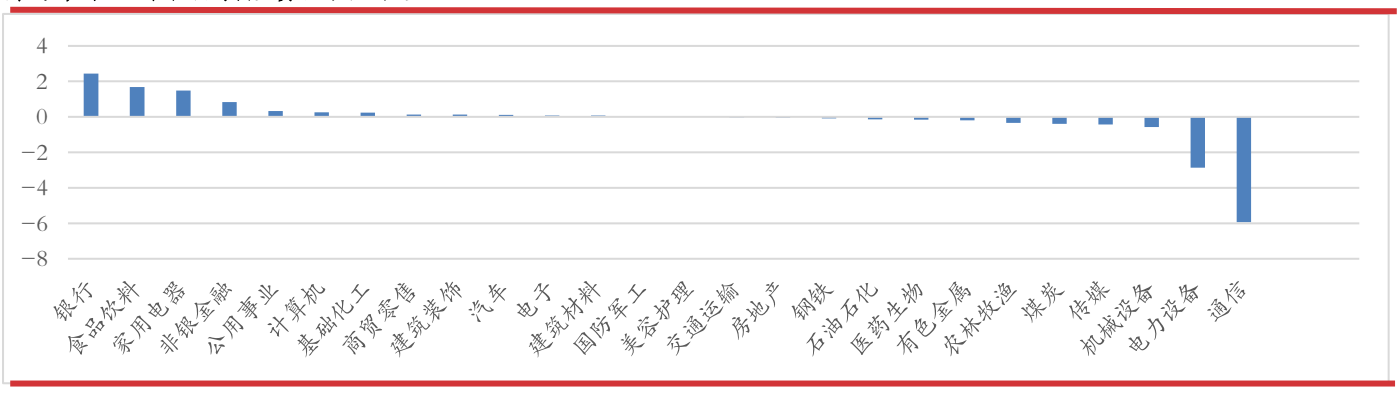
数据来源：Wind，光期研究所

图 4：中证 500 各板块对指数贡献的涨跌点数



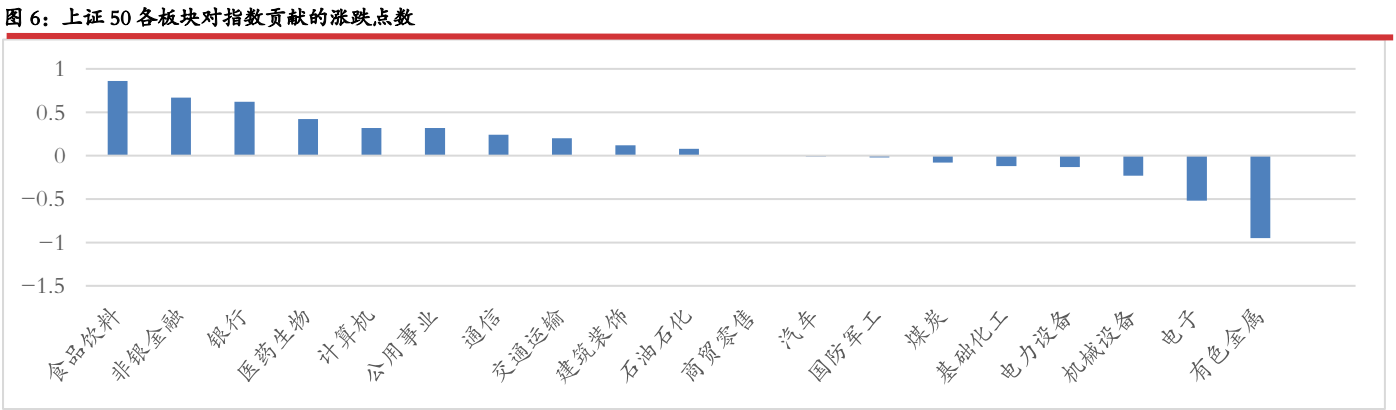
数据来源：Wind，光期研究所

图 5：沪深 300 各板块对指数贡献的涨跌点数



数据来源：Wind，光期研究所

图 6：上证 50 各板块对指数贡献的涨跌点数



数据来源：Wind，光期研究所

请务必阅读文末的免责声明

三、股指期货基差及基差折算年化开仓成本

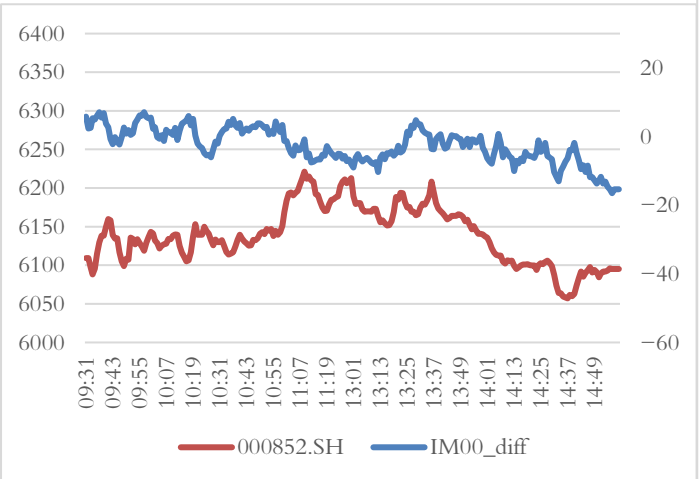
IM00 日均基差-2.58，IM01 日均基差-52.77，IM02 日均基差-199.22，IM03 日均基差-366.79;

IC00 日均基差-9.92，IC01 日均基差-69.05，IC02 日均基差-212.33，IC03 日均基差-372.85;

IF00 日均基差-9.95，IF01 日均基差-41.14，IF02 日均基差-109.03，IF03 日均基差-187.38;

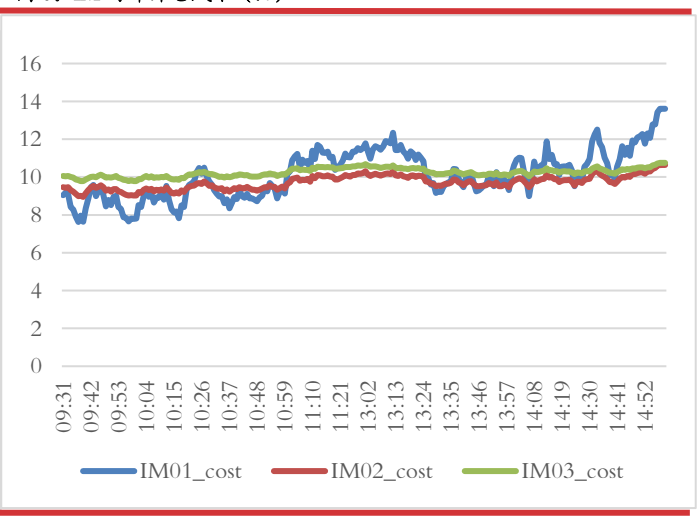
IH00 日均基差-5.0，IH01 日均基差-26.49，IH02 日均基差-71.78，IH03 日均基差-111.39;

图 7：中证 1000 指数与主力合约基差



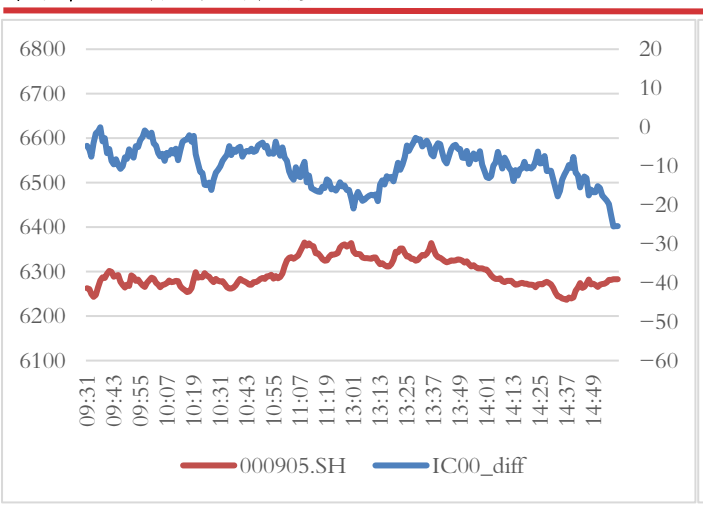
数据来源：Wind、光期研究所

图 8：IM 对冲开仓成本（%）



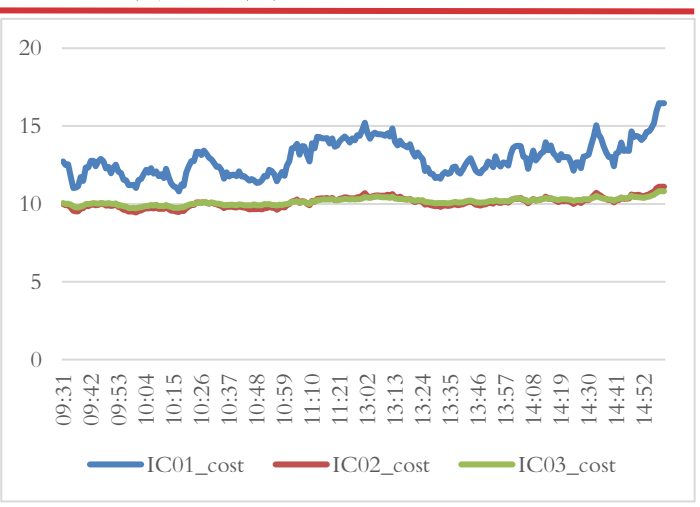
数据来源：Wind、光期研究所

图 9：中证 500 指数与主力合约基差



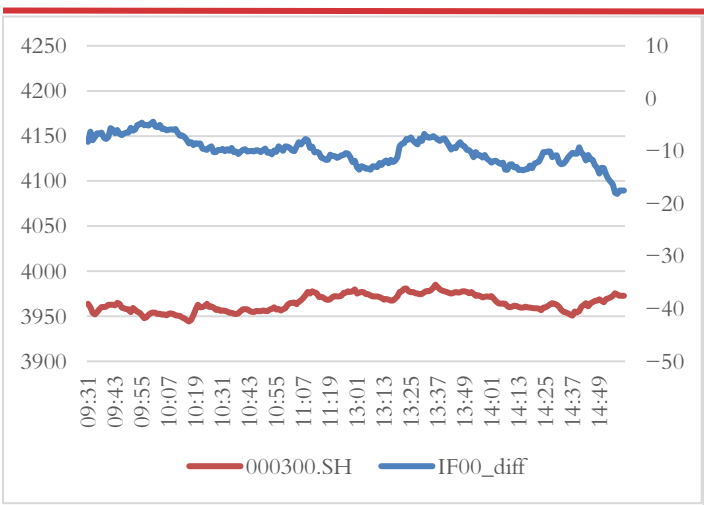
数据来源：Wind、光期研究所

图 10：IC 对冲开仓成本（%）



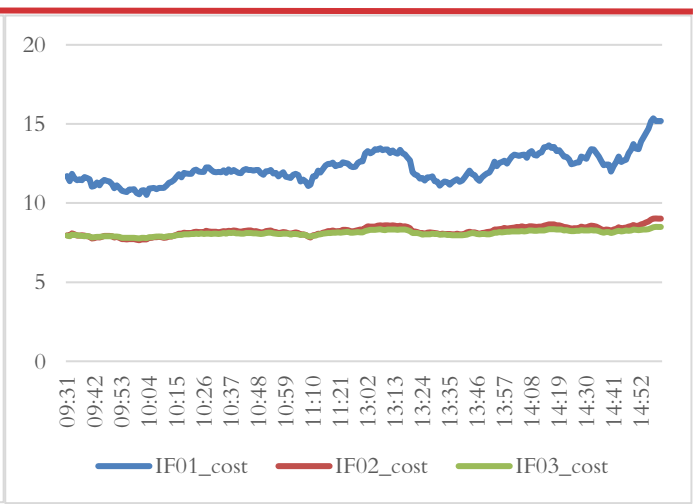
数据来源：Wind、光期研究所

图 11：沪深 300 指数与主力合约基差



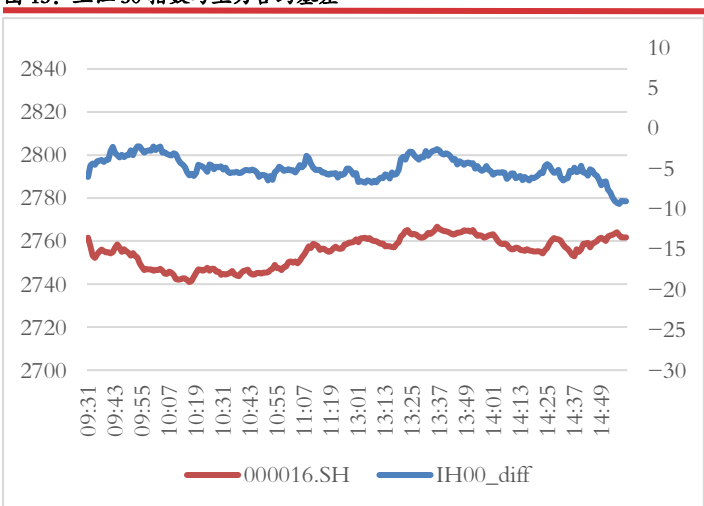
数据来源：Wind、光期研究所

图 12：IF 对冲开仓成本（%）



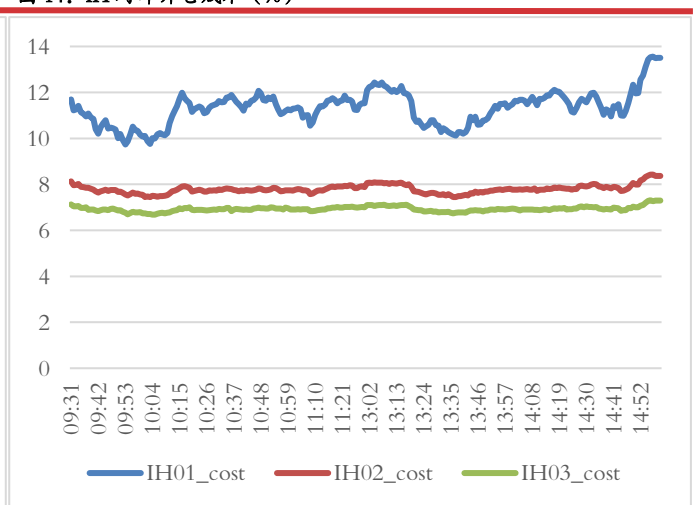
数据来源：Wind、光期研究所

图 13：上证 50 指数与主力合约基差



数据来源：Wind，光期研究所

图 14：IH 对冲开仓成本（%）



数据来源：Wind、光期研究所

请务必阅读文末的免责声明

报告撰写：

光大期货研究所 宏观金融组

金融工程分析师 王东瀛 期货从业资格号：F03087149；期货交易咨询资格号：Z0019537。

宏观金融团队成员介绍

•**朱金涛**，吉林大学经济学硕士，现任光大期货研究所宏观金融研究总监。期货从业资格号：F3060829；期货交易咨询资格号：Z0015271。

•**于洁**，上海外国语大学金融硕士，现任光大期货宏观分析师，历任混沌天成期货宏观分析师。期货从业资格号：F03088671 ；期货交易咨询资格号：Z0016642。

•**赵复初**，现任光大期货研究所金融期货分析师，英国杜伦大学金融学博士，英国苏塞克斯大 学管理学硕士。负责海外宏观与大类资产配置相关研究，在期货日报、华夏时报等主流媒体发表多篇文章。期货从业资格号：F03107639；期货交易咨询资格号：Z0021469。

•**王东瀛**，股指分析师，哥伦比亚硕士，主要跟踪股指期货品种，负责宏观基本面量化，重点行业板块研究，指数财报分析，市场资金面跟踪等内容。期货从业资格号：F03087149；期货交易咨询资格号：Z0019537。

免责声明

本报告的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性、可靠性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。我们已力求报告内容的客观、公正，但文中的观点、结论和建议仅供参考，并不构成任何具体产品、业务的推介以及相关品种的操作依据和建议，投资者据此作出的任何投资决策自负盈亏，与本公司和作者无关。