

撰写人: 张昕 从业资格号: F3073677 投资咨询从业证书号: Z0015602

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 (2208)	4214.8	-0.2↓	IF次主力合约 (2209)	4183.4	+0.4↑
	IH主力合约 (2208)	2823.8	-3.6↓	IH次主力合约 (2209)	2824.4	-3.2↓
	IC主力合约 (2208)	6305.6	+5.6↑	IC次主力合约 (2209)	6178.2	+9.6↑
	IM主力合约 (2208)	7119.0	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	6923.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1391.0	+5.2↑	IC-IF当月合约价差	2090.8	+5.8↑
	IM-IC当月合约价差	813.4		IC-IH当月合约价差	3481.8	+11.0↑
	IM-IF当月合约价差	2904.2		IM-IH当月合约价差	4295.2	
	IF当季-当月	-31.4	+0.6↑	IF下季-当月	-48.2	+0.2↑
	IH当季-当月	0.6	+0.2↑	IH下季-当月	2.8	+3.2↑
	IC当季-当月	-127.4	+2.6↑	IC下季-当月	-209.8	+2.8↑
IM当季-当月	-196.0		IM下季-当月	-331.4		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,912.00	-1372.0↓	IH前20名净持仓	-17,305	-239.0↓
	IC前20名净持仓	-11,049.00	-1167.0↓	IM前20名净持仓	-251	-2.0↓
现货价格	沪深300	4225.67	+0.6↑	IF主力合约基差	-10.9	-12.7↓
	上证50	2827.11	-2.8↓	IH主力合约基差	-3.3	+0.1↑
	中证500	6348.17	+15.9↑	IC主力合约基差	-42.6	-50.2↓
	中证1000	7150.20	+50.8↑	IM主力合约基差	-31.2	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,073.92	+1392.80↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,307.47	+43.68↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-37.38	+27.33↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-30	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-9.96	-158.71↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	60.15	+1.99↑	Shibor (日, %)	1.014	-0.004↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	84.00	-1.60↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	17.69	-0.01↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	68.80	-3.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.65	-0.33↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	12.57	-1.38↓	成交量PCR (%)	58.58	-11.61↓
				持仓量PCR (%)	67.33	+0.18↑
观点总结	全部A股	6.20	+0.30↑	技术面	6.00	+0.20↑
	资金面	6.40	+0.40↑			
重点关注的	1、6月份, 全国规模以上工业企业利润同比增长1%, 由降转升。疫情形势好转, 复工复产持续推进, 生产端持续恢复。分门类看, 采矿业利润同比增长77.9%, 增速较上月有所回落; 制造业利润同比下降9.0%, 降幅较上月收窄9.5个百分点; 电力、热力、燃气及水生产和供应业利润增长13.1%, 利润由降转增。					
	A股主要指数震荡整理, 成交量较前日有所提升。截至收盘, 上证指数涨0.21%报3282.58点, 深证成指涨0.23%, 创业板指跌0.31%。四期指分化, 上证50跌0.10%, 沪深300涨0.02%, 中证500涨0.25%, 中证1000涨0.72%。北向资金净买入27.33亿。从领涨板块看, 半导体、元器件、铝、铜等板块走强, 中小盘的题材股表现也更活跃, 整体资金情绪较好, 或在等待7月末政治局会议的靴子落地, 方向上需重点关注会议对稳增长的新一步政策。整体上A股回调逐渐企稳, 但短期波动仍将持续, 叠加海外市场影响和疫情反复, 或需要一段时间整理; 中长期则仍有上升空间。技术面上, 中长线价值明确, 结合低估值以及疫情修复逻辑, 在稳增长政策发力下, 建议轻仓介入多IC合约。					
7-28 02:00 美国FOMC利率决策(上限);美国FOMC利率决策(下限); 02: 30 美联储主席鲍威尔召开货币政策新闻发布会 7-29 20: 30 美国6月个人消费支出(PCE)环比; 22: 30 美国7月密歇根大学消费者信心指数终值						



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!