

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)	4174.0	+16.2↑	IF次主力合约 (2209)	4136.2	+13.6↑
	IH主力合约 (2208)	2778.0	-11.4↓	IH次主力合约 (2209)	2778.4	-9.6↓
	IC主力合约 (2208)	6311.4	+49.4↑	IC次主力合约 (2209)	6175.4	+45.4↑
	IM主力合约 (2208)	7136.6	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	6930.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1396.0	+28.4↑	IC-IF当月合约价差	2137.4	+34.6↑
	IM-IC当月合约价差	825.2		IC-IH当月合约价差	3533.4	+63.0↑
	IM-IF当月合约价差	2962.6		IM-IH当月合约价差	4358.6	
	IF当季-当月	-37.8	-1.0↓	IF下季-当月	-58.2	-6.4↓
	IH当季-当月	0.4	-0.4↓	IH下季-当月	1	-4.0↓
	IC当季-当月	-136.0	-8.6↓	IC下季-当月	-219.2	-0.8↓
IM当季-当月	-206.6		IM下季-当月	-358		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-16,299.00	+669.0↑	IH前20名净持仓	-16,394	+1021.0↑
	IC前20名净持仓	-8,483.00	+291.0↑	IM前20名净持仓	37	+1356.0↑
现货价格	沪深300	4188.68	+18.6↑	IF主力合约基差	-14.7	-36.3↓
	上证50	2781.68	-10.7↓	IH主力合约基差	-3.7	+3.1↑
	中证500	6347.22	+53.1↑	IC主力合约基差	-35.8	-92.0↓
	中证1000	7180.45	+63.0↑	IM主力合约基差	-43.8	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,938.61		两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,274.72	-45.50↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)		+23.98	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-50	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-448.73	-62.20	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	52.42	+23.80↑	Shibor (日, %)	1.177	-0.077↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	63.00	+3.60↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	18.66	-2.77↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	89.40	-13.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.98	-0.39↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	12.89	-0.19↓	成交量PCR (%)	94.70	+11.84↑
				持仓量PCR (%)	66.43	+1.79↑
观点总结	全部A股	6.00	+2.60↑	技术面	5.20	+2.40↑
	资金面	6.80	+2.80↑			
重点关注的	1、国家统计局: 中国7月官方制造业PMI为49, 位于临界点以下, 制造业景气水平有所回落, 预期50.4, 前值50.2; 官方非制造业PMI为53.8, 预期53.8, 前值54.7, 资本市场服务、保险、房地产、租赁及商务服务等行业商务活动指数低于临界点。7月综合PMI产出指数为52.5, 仍高于临界点, 表明我国企业生产经营总体继续恢复性扩张。					
	A股主要指数午后震荡, 收盘时缩量上涨。沪指收涨0.21%, 深指涨1.2%, 创业板指涨2.37%。四期指分化, 上证50跌0.38%, 沪深300涨0.45%, 中证500涨0.84%, 中证1000涨0.89%。北向资金净买入23.98亿。上周四中央召开政治局会议, 分析研究当前经济形势, 部署下半年经济工作, 对经济目标增长有所放松, 或向市场注入偏弱的基本面信号。海外市场方面, 随着美联储加息落地, 海外市场对继续加息预期降低, 波动因素或将边际减弱。整体上A股回调逐渐企稳, 但短期波动仍将持续, 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。					
	8-1 22: 00 美国7月ISM制造业指数 8-2 22: 00 美国芝加哥联储主席埃文斯主持媒体早餐会, 讨论美国经济和货币政策 8-3 9: 45 中国7月财新服务业PMI; 中国7月财新综合PMI; 22: 00 美国7月ISM非制造业指数; 美国6月扣除飞机非国防资本耐用品订单环比终值; 美国6月耐用品订单环比终值; 22: 30 美国7月29日当周EIA原油库存变动(万桶)					