

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)	4179.0	-40.4↓	IF次主力合约 (2209)	4153.2	-40.6↓
	IH主力合约 (2208)	2758.6	-29.8↓	IH次主力合约 (2209)	2767.8	-28.4↓
	IC主力合约 (2208)	6471.4	-24.0↓	IC次主力合约 (2209)	6343.0	-21.2↓
	IM主力合约 (2208)	7358.8	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	7161.6	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1420.4	-10.2↓	IC-IF当月合约价差	2292.4	+14.2↑
	IM-IC当月合约价差	887.4		IC-IH当月合约价差	3712.8	+4.0↑
	IM-IF当月合约价差	3179.8		IM-IH当月合约价差	4600.2	
	IF当季-当月	-25.8	+0.4↑	IF下季-当月	-47.6	-4.6↓
	IH当季-当月	9.2	+2.8↑	IH下季-当月	15.4	+2.4↑
	IC当季-当月	-128.4	+2.8↑	IC下季-当月	-217.2	+1.2↑
IM当季-当月	-197.2		IM下季-当月	-348		
期货持仓寸 (净多)	IF前20名净持仓	-15,431.00	+619.0↑	IH前20名净持仓	-18,969	-489.0↓
	IC前20名净持仓	-4,387.00	+641.0↑	IM前20名净持仓	-1947	+603.0↑
现货价格	沪深300	4180.10	-36.9↓	IF主力合约基差	-1.1	+34.1↑
	上证50	2759.29	-26.6↓	IH主力合约基差	-0.7	+24.3↑
	中证500	6468.81	-24.7↓	IC主力合约基差	2.6	+23.6↑
	中证1000	7351.44	+22.8↑	IM主力合约基差	7.4	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,541.00	-203.49↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,422.64	+36.82↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+68.72	-46.13↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-154.38	-312.37↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	40.39	-16.76↓	Shibor (日, %)	1.187	+0.049↑
观点总结	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	7.60	-21.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	14.91	+3.69↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	29.00	+13.00↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	15.12	+4.23↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	15.20	-0.20↓	成交量PCR (%)	69.02	-0.24↓
				持仓量PCR (%)	64.62	-5.03↓
Wind市场强弱分析	全部A股	4.30	-1.60↓	技术面	4.00	-1.10↓
	资金面	4.50	-2.20↓			
行业消息	1、近期多地发布限电通知, 从8月1日至8月17日, 有26家上市公司发布限产公告, 占总体比重为0.6%, 较7月的9家和0.2%有所上升, 但是低于2021年9月的46家和1.1%。					
观点总结	<p>A股主要指数收跌, 市场成交量缩小。沪指、深成指弱势下行, 创业板指早盘冲高回落, 午后震荡整理。截至收盘, 沪指跌0.46%, 深成指跌0.62%, 创业板指微跌0.08%。四期指中仅中证1000小幅收涨, 沪深300以及上证50代表的大盘走势相对更弱。北向资金大幅净流出46.13亿元。近期A股行情表现为, 热点轮动较快, 市场缺乏主线, 蓝筹表现相对低迷, 中小市值活跃度较高。当前宏观层面面临的阶段性不确定性和挑战较多有关, 7月份经济下滑打破市场对于宏观基本面回暖的预期, 居民和企业对于未来信心亦有所抑制。然结合央行二季度货币政策报告以及最新社融数据来看, 宏观流动性仍以宽松为主, 流动性充裕对市场有一定支持。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。</p>					
重点关注	8-18 20: 30 美国8月13日当周首次申请失业救济人数(万人); 22: 30 美国7月成屋销售总数年化(万户)					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!