

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)	4059.8	-55.4↓	IF次主力合约 (2209)	4026.6	-53.8↓
	IH主力合约 (2208)	2713.6	-17.6↓	IH次主力合约 (2209)	2714.6	-16.6↓
	IC主力合约 (2208)	6102.6	-87.8↓	IC次主力合约 (2209)	5980.2	-84.0↓
	IM主力合约 (2208)	6882.8	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	6688.8	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1346.2	-31.4↓	IC-IF当月合约价差	2042.8	-15.2↓
	IM-IC当月合约价差	780.2		IC-IH当月合约价差	3389.0	-46.6↓
	IM-IF当月合约价差	2823.0		IM-IH当月合约价差	4169.2	
	IF当季-当月	-33.2	+1.8↑	IF下季-当月	-47.6	+7.8↑
	IH当季-当月	1.0	-0.2↓	IH下季-当月	9.2	+6.0↑
	IC当季-当月	-122.4	-10.0↓	IC下季-当月	-206.2	-2.2↓
IM当季-当月	-194.0		IM下季-当月	-346		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-18,273.00	-1467.0↓	IH前20名净持仓	-16,223	+647.0↑
	IC前20名净持仓	-6,232.00	-2296.0↓	IM前20名净持仓	-251	+199.0↑
现货价格	沪深300	4066.98	-40.1↓	IF主力合约基差	-7.2	+42.4↑
	上证50	2710.72	-20.0↓	IH主力合约基差	2.9	+21.1↑
	中证500	6124.31	-45.7↓	IC主力合约基差	-21.7	+43.1↑
	中证1000	6916.67	-41.3↓	IM主力合约基差	-33.9	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	11,149.60	-661.65↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,178.96	-136.79↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-23.11	-10.49↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-834.78	-298.28↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	35.49	+27.29↑	Shibor (日, %)	1.026	-0.050↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	60.00	-33.20↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	21.54	-9.78↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	99.00	+10.80↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	21.50	-10.30↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	13.69	+1.17↑	成交量PCR (%)	91.37	-10.91↓
				持仓量PCR (%)	59.47	-4.24↓
观点总结	全部A股	3.80	+1.70↑	技术面	3.50	+2.70↑
	资金面	4.10	+0.70↑			
重点关注的	1、8月3日公布的7月财新中国通用服务业经营活动指数 (服务业PMI) 录得55.5, 较6月上升1.0个百分点, 连续第二个月位于扩张区间, 并且创2021年5月以来新高。7月服务业供给和需求继续回暖, 经营活动指数和新订单指数均在扩张区间小幅上升, 分别升至近15个月来和近九个月来最高。受调查企业反映, 最近防疫措施放宽支撑产出增长和客户需求改善。不过, 仍有部分企业表示经营活动继续受疫情限制。此外, 7月新出口订单指数在收缩区间回落, 显示外需仍相对较弱。					
	A股主要指数高开低走, 尾盘跳水, 截止收盘缩量下跌, 沪指收跌0.71%, 深指跌1.14%, 创业板指跌1.86%。四期指全线收跌, 上证50跌0.73%, 沪深300跌0.97%, 中证500跌0.74%, 中证1000跌0.59%。北向资金净卖出10.49亿。海外市场方面, 三位美联储决策者周二表示, 他们及其同僚仍坚定不移、“团结一致”地致力于加息至能够更明显地抑制经济活动的水平, 或引发对美元进一步收缩和经济下行的担忧。地缘政治事件持续影响投资者情绪, 事态后续发展或在后市加剧亚太股市波动, 但A股长期疫情修复逻辑不变。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。					
8-3 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)						
8-4 20: 30 美国7月30日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国6月贸易帐(亿美元)						



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

瑞达研究