

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 (2207)	4273.0	+32.8↑	IF次主力合约 (2209)	4236.6	+31.6↑
	IH主力合约 (2207)	2873.8	+33.0↑	IH次主力合约 (2209)	2869.0	+25.2↑
	IC主力合约 (2207)	6270.0	+91.6↑	IC次主力合约 (2209)	6150.6	+91.0↑
	IF-IH当月合约价差	1399.2	+13.0↑	IC-IF当月合约价差	1997.0	+64.6↑
				IC-IH当月合约价差	3396.2	+77.6↑
	IF当季-当月	-36.4	+1.6↑	IF下季-当月	-58	-53.0↓
	IH当季-当月	-4.8	-2.8↓	IH下季-当月	-8	-28.0↓
	IC当季-当月	-119.4	-5.6↓	IC下季-当月	-210.4	-127.6↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,416.00	-3008.0↓	IH前20名净持仓	-14,361	-354.0↓
	IC前20名净持仓	-12,342.00	+115.0↑			
现货价格	沪深300	4292.59	+44.1↑	IF主力合约基差	-19.6	-82.6↓
	上证50	2878.64	+39.3↑	IH主力合约基差	-4.8	-54.8↓
	中证500	6312.36	+115.6↑	IC主力合约基差	-42.4	-170.0↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,213.83		两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,172.01	-59.93↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-89.31	+35.52↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-30	+120
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-368.89	+28.06↑	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	85.27	+64.46↑	Shibor (日, %)	1.218	+0.007↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	88.20	+18.80↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	18.75	-4.60↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	115.60	-35.40↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.96	+1.12↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.59	+0.33↑	成交量PCR (%)	81.31	-9.39↓
			持仓量PCR (%)	90.70		
Wind市场强弱分析	全部A股	8.00	+5.10↑	技术面	8.50	+6.50↑
	资金面	7.50	+3.70↑			
行业消息	1、7月16日中国人民银行消息, 人民银行行长易纲日前表示, 中国通胀较低, 预期保持稳定, 受疫情和外部冲击的影响, 中国经济面临一定下行压力, 人民银行将加大稳健货币政策的实施力度, 为实体经济提供更有力的支持。				 <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数集体收涨, 缩量反弹。沪指收涨1.55%, 深指涨0.98%, 创业板指收涨1.44%。三期指全线上涨, 上证50涨1.38%, 沪深300涨1.04%, 中证500涨1.86%。北向资金净流入, 达35.52亿。上周宏观经济数据出炉后, 市场认为经济底已现, 新能源等赛道板块基本面与政策面上皆较稳定, 中报业绩高景气的态势维持。上周影响较大的村镇银行和房贷断供事件方面, 银保监会周末正面回应, 基本上得到一定程度修复。技术面上, 指数短线连续杀跌后利空情绪有所稳定, 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>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	7-18 20: 30 美国6月新屋开工(万户) 7-20 09: 15 中国7月五年期贷款市场报价利率(LPR) ; 中国7月一年期贷款市场报价利率(LPR); 22: 00 美国6月成屋销售总数年化(万户); 22: 30 美国7月15日当周EIA原油库存变动(万桶) 7-21 待定 日本央行政策利率; 20: 30 美国7月16日当周首次申请失业救济人数(万人)					