

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 (2210)	3890.2	+40.4↑	IF次主力合约 (2212)	3886.4	+41.8↑
	IH主力合约 (2210)	2642.0	+19.6↑	IH次主力合约 (2212)	2650.2	+19.2↑
	IC主力合约 (2210)	5912.6	+94.4↑	IC次主力合约 (2212)	5857.8	+91.4↑
	IM主力合约 (2210)	6398.8	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6300.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1248.2	+21.8↑	IC-IF当月合约价差	2022.4	+59.4↑
	IM-IC当月合约价差	486.2	+35.6↑	IC-IH当月合约价差	3270.6	+81.2↑
	IM-IF当月合约价差	2508.6	+95.0↑	IM-IH当月合约价差	3756.8	+116.8↑
	IF当季-当月	-3.8	+1.8↑	IF下季-当月	-12.8	-0.2↓
	IH当季-当月	8.2	-0.2↓	IH下季-当月	18.2	-4.8↓
	IC当季-当月	-54.8	-0.2↓	IC下季-当月	-134.8	+8.6↑
IM当季-当月	-98.8	-2.8↓	IM下季-当月	-220.2	-0.4↓	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,458.00	-47.0↓	IH前20名净持仓	-25,747	-120.0↓
	IC前20名净持仓	5,756.00	+1367.0↑	IM前20名净持仓	-361	+1532.0↑
现货价格	沪深300	3892.30	+55.6↑	IF主力合约基差	-2.1	+4.7↑
	上证50	2642.92	+28.0↑	IH主力合约基差	-0.9	+0.1↑
	中证500	5920.05	+113.7↑	IC主力合约基差	-7.4	-1.9↓
	中证1000	6409.78	+126.2↑	IM主力合约基差	-11.0	-28.6↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	6,662.05	-17.49↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,729.11	-62.81↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+42.77	+32.72	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+1750
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-138.78	+13.37	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	88.69	+70.01↑	Shibor (日, %)	1.399	-0.030↓
观点总结	IO平值看涨期权收盘价 (2210)	67.80	+15.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.88	-5.02↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2210)	75.80	+75.80↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.99	-6.55↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	13.87	+1.49↑	成交量PCR (%)	85.74	-5.60↓
				持仓量PCR (%)	74.82	+2.06↑
Wind市场强弱分析	全部A股	8.30	+5.40↑	技术面	8.90	+7.00↑
	资金面	7.60	+3.60↑			
行业消息	1、9月27日, 国家统计局公布数据显示, 1-8月份, 全国规模以上工业企业实现利润总额55254.0亿元, 同比下降2.1%。国家统计局工业司高级统计师朱虹解读工业企业利润数据称, 1-8月份工业企业利润有所下降。				 <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数收涨。两市股指早盘窄幅震荡上扬, 午后强势反攻, 沪指涨超1%, 深成指涨近2%, 创业板指涨超2%。四期指均大幅收涨, 中证1000涨幅超过2%。市场成交量尚未明显提升。静待十月份二十大政策定调, 提振市场整体做多情绪, 引领增量资金入市。中长线上, 历史复盘来看, 本轮回撤幅度以及时间区间已经接近历史平均水平, 结合当前指数估值仍处于低位, 预计大盘下行空间有限。技术面上, 指数中长线价值明确, 结合低估值以及疫情修复逻辑, 以及海内外风险放大的背景下, 大盘后续倾向均衡风格, 建议轻仓介入多IF空IM合约。				 <p>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	9-27 20: 30 美国8月耐用品订单环比初值; 22: 00 美国8月新屋销售(万户); 美国9月谘商会消费者信心指数 9-28 20: 30 美国8月商品贸易帐(亿美元); 22: 00 美国8月成屋签约销售指数同比; 22: 30 美国9月23日当周EIA原油库存变动(万桶) 9-29 20: 30 美国二季度个人消费支出(PCE)年化季环比终值; 美国二季度实际GDP年化季环比终值; 美国9月24日当周首次申请失业救济人数(万人)					