

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)	3836.6	-52.0↓	IF次主力合约 (2212)	3833.0	-51.4↓
	IH主力合约 (2210)	2613.4	-27.6↓	IH次主力合约 (2212)	2621.6	-26.8↓
	IC主力合约 (2210)	5772.0	-132.0↓	IC次主力合约 (2212)	5721.2	-125.6↓
	IM主力合约 (2210)	6202.6	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6122.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1223.2	-25.0↓	IC-IF当月合约价差	1935.4	-87.0↓
	IM-IC当月合约价差	430.6	-55.6↓	IC-IH当月合约价差	3158.6	-112.0↓
	IM-IF当月合约价差	2366.0	-142.6↓	IM-IH当月合约价差	3589.2	-167.6↓
	IF当季-当月	-3.6	+0.2↑	IF下季-当月	-11	+1.8↑
	IH当季-当月	8.2	-0.0↓	IH下季-当月	20.6	+2.4↑
	IC当季-当月	-50.8	+4.0↑	IC下季-当月	-127.8	+7.0↑
IM当季-当月	-80.6	+18.2↑	IM下季-当月	-188.4	+31.8↑	
期货持仓寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,855.00	-397.0↓	IH前20名净持仓	-24,466	+1281.0↑
	IC前20名净持仓	7,075.00	+1309.0↑	IM前20名净持仓	-589	-228.0↓
现货价格	沪深300	3828.71	-63.6↓	IF主力合约基差	7.9	-2.1↓
	上证50	2611.98	-30.9↓	IH主力合约基差	1.4	-0.9↓
	中证500	5769.52	-150.5↓	IC主力合约基差	2.5	-7.4↓
	中证1000	6211.11	-198.7↓	IM主力合约基差	-8.5	-11.0↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,197.91	+3518.37↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,728.37	-0.74↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+32.72	-38.40↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+2000
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+13.37	-391.26↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	8.70	-79.99↓	Shibor (日, %)	1.270	-0.129↓
观点总结	IO平值看涨期权收盘价 (2210)	63.40	-34.60↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.97	+0.43↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2210)	76.80	+24.60↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	20.45	+2.28↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.73	+0.86↑	成交量PCR (%)	93.19	+7.43↑
				持仓量PCR (%)	70.01	-4.67↓
Wind市场强弱分析	全部A股	2.20	-6.10↓	技术面	0.90	-8.00↓
	资金面	3.50	-4.10↓			
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股主要指数放量下跌。两市股指低开低走, 盘中单边大幅下探, 沪指盘中跌超1.5%, 深成指、创业板指、科创50指数跌超2%。四期指均大幅下行, 中证500跌幅超过2%, 中证1000收跌超过3%。美元走强、全球范围央行加息抗通胀导致经济衰退恐慌预期下, 外围市场持续偏负面影响, 全球市场风险偏好受到打击。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	9-28 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) 9-30 09: 30 中国9月官方非制造业PMI; 中国9月官方制造业PMI; 中国9月官方综合PMI; 中国9月财新制造业PMI; 20: 30 美国8月个人消费支出(PCE)环比; 美国8月个人收入环比; 22: 00 美国9月密歇根大学消费者信心指数终值					