

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 (2209)	4029.8	-39.8↓	IF次主力合约 (2212)	4023.0	-37.8↓
	IH主力合约 (2209)	2746.4	-4.4↓	IH次主力合约 (2212)	2755.0	-3.4↓
	IC主力合约 (2209)	6100.6	-155.2↓	IC次主力合约 (2212)	6006.0	-161.6↓
	IM主力合约 (2209)	6596.4	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6410.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1283.4	-35.6↓	IC-IF当月合约价差	2070.8	-113.2↓
	IM-IC当月合约价差	495.8	-77.4↓	IC-IH当月合约价差	3354.2	-148.8↓
	IM-IF当月合约价差	2566.6	-190.6↓	IM-IH当月合约价差	3850.0	-226.2↓
	IF当季-当月	-6.8	+2.4↑	IF下季-当月	-18	+2.4↑
	IH当季-当月	8.6	-0.4↓	IH下季-当月	21.8	-0.8↓
	IC当季-当月	-94.6	-7.8↓	IC下季-当月	-185.6	-7.0↓
IM当季-当月	-186.4	-23.4↓	IM下季-当月	-337.8	-21.6↓	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,010.00	+3980.0↑	IH前20名净持仓	-24,546	+3271.0↑
	IC前20名净持仓	-8,756.00	-8870.0↓	IM前20名净持仓	-606	+1521.0↑
现货价格	沪深300	4027.12	-38.2↓	IF主力合约基差	2.7	+3.4↑
	上证50	2743.79	-1.6↓	IH主力合约基差	2.6	+4.4↑
	中证500	6107.80	-142.2↓	IC主力合约基差	-7.2	+2.8↑
	中证1000	6619.19	-210.4↓	IM主力合约基差	-22.8	-3.6↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,191.18	+1963.91↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,055.60	-10.01↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-14.41	-41.33↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-301.94	-625.36↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)	-2000	+4000
	上涨股票比例 (日, %)	13.84	-9.63↓	Shibor (日, %)	1.226	+0.053↑
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2209)	6.60	-23.40↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	13.88	+3.31↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2209)	26.80	+14.80↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	14.33	+7.27↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	12.53	-0.34↓	成交量PCR (%)	87.65	+4.74↑
				持仓量PCR (%)	54.84	-7.28↓
观点总结	全部A股	2.50	-0.70↓	技术面	1.40	-0.90↓
	资金面	3.60	-0.40↓			
重点关注	1、国务院总理李克强9月13日主持召开国务院常务会议, 决定进一步延长制造业缓税补缴期限, 加力助企纾困; 确定专项再贷款与财政贴息配套支持部分领域设备更新改造, 扩市场需求、增发展后劲; 部署进一步稳外贸稳外资的举措, 助力经济巩固恢复基础; 确定优化电子电器行业管理的措施, 降低制度性交易成本, 更大激发市场活力; 决定核准福建漳州二期和广东廉江一期核电项目, 要求确保绝对安全。					
	A股主要指数收跌, 市场放量下跌。两市股指低开低走, 午后加速下行。截至收盘, 沪指跌1.16%, 深证成指跌2.1%, 创业板指跌3.18%。四期指均下行, 中证500以及中证1000收跌超过2%。北向资金大幅净流出。目前市场成交相对前期低迷, 然而中长线看来, 指数估值水平较低且处于历史低位, 后续下行空间不大。而结合政策和基本面来看, 国常会对于政策的表态相对积极, 主基调仍是传递托底经济的信号。而从中报业绩看, 当前A股盈利预期处于底部修复周期, 全A净利润降幅收窄, 亦呈现的是相对积极的信号, 市场不宜过分悲观。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。					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!