

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)	3784.6	+54.2↑	IF次主力合约 (2212)	3787.0	+50.8↑
	IH主力合约 (2210)	2554.6	+13.6↑	IH次主力合约 (2212)	2561.6	+12.6↑
	IC主力合约 (2210)	5812.8	+125.4↑	IC次主力合约 (2212)	5778.6	+125.6↑
	IM主力合约 (2210)	6169.2	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6074.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1230.0	+41.6↑	IC-IF当月合约价差	2028.2	+72.2↑
	IM-IC当月合约价差	356.4	+45.0↑	IC-IH当月合约价差	3258.2	+113.8↑
	IM-IF当月合约价差	2384.6	+117.2↑	IM-IH当月合约价差	3614.6	+158.8↑
	IF当季-当月	2.4	-3.2↓	IF下季-当月	4.6	-1.6↓
	IH当季-当月	7.0	-0.6↓	IH下季-当月	18.6	-1.0↓
	IC当季-当月	-34.2	+2.4↑	IC下季-当月	-107.8	-1.8↓
IM当季-当月	-95.2	-1.6↓	IM下季-当月	-233.4	-17.0↓	
期货持仓寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,390.00	+1470.0↑	IH前20名净持仓	-27,163	+1665.0↑
	IC前20名净持仓	7,463.00	+1982.0↑	IM前20名净持仓	32	+621.0↑
现货价格	沪深300	3784.31	+56.6↑	IF主力合约基差	0.3	-0.9↓
	上证50	2555.02	+15.1↑	IH主力合约基差	-0.4	-1.6↓
	中证500	5820.45	+136.0↑	IC主力合约基差	-7.6	-1.7↓
	中证1000	6192.65	+174.9↑	IM主力合约基差	-23.5	-23.5↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	7,102.17	+1464.01↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,370.51	+3.88↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-12.44	-58.76↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-670	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-40.11	+48.56↑	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	92.00	+31.05↑	Shibor (日, %)	1.155	-0.028↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2210)	39.40	+16.20↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	18.05	-2.95↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2210)	54.60	-39.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.21	-3.51↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.96	+0.74↑	成交量PCR (%)	75.49	-13.22↓
				持仓量PCR (%)	51.11	+0.41↑
观点总结	全部A股	8.50	+2.20↑	技术面	9.20	+3.10↑
	资金面	7.80	+1.30↑			
重点关注的消息	1、央行: 中国9月M2同比增长12.1%, 增速比上月末低0.1个百分点; 人民币贷款增加2.47万亿元, 同比多增8108亿元; 社会融资规模增量为3.53万亿元, 比上年同期多6245亿元。9月末社会融资规模存量为340.65万亿元, 同比增长10.6%。					
	A股主要指数放量上涨。两市股指早盘弱势震荡下探, 三大股指盘中跌幅均超1%, 午后止跌回升, 强势反弹, 沪指涨超1.5%收复3000点, 深成指涨超2%, 创业板指涨超3%。四期指齐收涨, 中证500以及中证1000表现强势, 收涨接近3%。北向资金大幅净流出, 主力资金大幅净流入。当前A股估值已经调整至低估区域, 并且随着市场逐步消化悲观情绪, 后续指数有望底部反弹。海外经济增长动能回落同时货币紧缩预期增强, 外围市场风险偏好回落趋势尚在, 海内外不确定性因素或仍对A股独立性走势形成干扰。国内层面, 9月份金融数据超预期增长, 政策推动的外生因素以及经济运逐步修复的内在原因共同推动信贷回暖。综合来看, 随着海内外空头情绪逐渐缓解, 后续市场风格预计偏均衡, 建议投资者关注景气修复和政策导向型机会。技术面上, 市场风格或向均衡方向倾斜, 可选择区间低配操作或轻仓介入多IF空IM合约。					
重点关注的消息	10-12 20: 30 美国9月PPI同比; 美国9月核心PPI环比; 美国9月PPI环比; 美国9月核心PPI同比					
	10-13 20: 30 美国10月8日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国9月核心CPI同比; 美国9月CPI同比; 美国9月核心CPI环比; 美国9月CPI环比; 23: 00 美国10月7日当周EIA原油库存变动(万桶)					
重点关注的消息	10-14 09: 30 中国9月CPI同比; 中国9月PPI同比; 22: 00 美国10月密歇根大学消费者信心指数初值					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!