

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)	4046.8	+41.2↑	IF次主力合约 (2212)	4036.8	+44.8↑
	IH主力合约 (2209)	2724.4	+29.2↑	IH次主力合约 (2212)	2732.2	+30.4↑
	IC主力合约 (2209)	6272.6	+122.6↑	IC次主力合约 (2212)	6175.0	+124.6↑
	IM主力合约 (2209)	6879.8	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6722.4	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1322.4	+7.6↑	IC-IF当月合约价差	2225.8	+85.0↑
	IM-IC当月合约价差	607.2	+18.4↑	IC-IH当月合约价差	3548.2	+92.6↑
	IM-IF当月合约价差	2833.0	+103.4↑	IM-IH当月合约价差	4155.4	+111.0↑
	IF当季-当月	-10.0	+1.6↑	IF下季-当月	-21.4	+5.4↑
	IH当季-当月	7.8	+2.6↑	IH下季-当月	18.6	+1.6↑
	IC当季-当月	-97.6	-0.6↓	IC下季-当月	-200.2	-0.2↓
IM当季-当月	-157.4	+0.4↑	IM下季-当月	-313	+2.0↑	
期货持仓寸 (净多)	IF前20名净持仓	-15,506.00	+1149.0↑	IH前20名净持仓	-21,123	-2143.0↓
	IC前20名净持仓	354.00	+633.0↑	IM前20名净持仓	-175	+620.0↑
现货价格	沪深300	4052.28	+36.9↑	IF主力合约基差	-5.5	+2.2↑
	上证50	2724.50	+26.7↑	IH主力合约基差	-0.1	+5.0↑
	中证500	6291.57	+108.9↑	IC主力合约基差	-19.0	-24.3↓
	中证1000	6919.65	+128.6↑	IM主力合约基差	-39.9	-43.9↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	8,691.57	+994.94↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,095.25	-15.93↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-76.15	-38.99↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-137.98	+137.79↑	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	74.22	+21.80↑	Shibor (日, %)	1.069	+0.036↑
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2209)	43.20	+6.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	16.06	-9.43↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2209)	45.40	-23.00↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	16.20	-5.02↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	13.82	+0.48↑	成交量PCR (%)	67.12	-8.56↓
				持仓量PCR (%)	58.55	+4.08↑
观点总结	全部A股	7.40	+1.90↑	技术面	7.40	+2.20↑
	资金面	7.40	+1.60↑			
重点消息	1、中国人民银行决定,自9月15日起,下调金融机构外汇存款准备金率2个百分点至6%。央行副行长刘国强表示,人民币并没有出现全面贬值。人民币长期的趋势应该是明确的,未来世界对人民币的认可度会不断增强,但是短期内双向波动是一种常态。民生银行首席经济学家温彬表示,下调外汇存款准备金,有助于增加市场上美元流动性,并提升金融机构外汇资金运用能力,有利于人民币汇率的稳定。					
	A股主要指数收涨。沪指盘中强势走高,午后再度走高,尾盘站稳3200点,深成指亦走高涨幅约1%,创业板指止跌回升,尾盘翻红。四期指均收涨,中证500以及中证1000收涨接近2%。北向资金净流出39亿元。央行决定自9月15日起,下调金融机构外汇存款准备金率2个百分点至6%。下调外汇存款准备金,有助于增加市场上美元流动性,有利于维稳人民币汇率。当前市场,相对而言,大盘以及权重跌幅较小,小盘科技估值下行加速,北上资金初步加仓低估值蓝筹,预计后续市场风格将有所切换,偏均衡为主。基本上,8月份PMI数据显示景气度环比小幅上升,内需呈现回暖的倾向,政策效应对冲疫情以及局部地区高温对制造业的影响。预计在宽松流动性的资金环境下,市场底部支撑较强,静待宽货币向宽信用的进一步落实,以及政策发力下稳增长对经济的拉升作用显现。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,在宏观经济数据出炉后的可能政策发力下,建议轻仓介入多IF空IM合约。					
重点消息	9-6 20: 30 美国7月贸易帐(亿美元)					
	9-8 02: 00 美联储公布经济状况褐皮书; 20: 30 美国9月3日当周首次申请失业救济人数(万人); 23: 00 美国9月2日当周EIA原油库存变动(万桶)					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!