

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 (2208)	4091.0	+21.8↑	IF次主力合约 (2209)	4059.2	+19.8↑
	IH主力合约 (2208)	2740.2	+25.2↑	IH次主力合约 (2209)	2740.0	+24.2↑
	IC主力合约 (2208)	6124.4	+0.8↑	IC次主力合约 (2209)	5988.8	-3.0↓
	IM主力合约 (2208)	6890.8	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	6687.6	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1350.8	+4.6↑	IC-IF当月合约价差	2033.4	-9.4↓
	IM-IC当月合约价差	766.4		IC-IH当月合约价差	3384.2	-4.8↓
	IM-IF当月合约价差	2799.8		IM-IH当月合约价差	4150.6	
	IF当季-当月	-31.8	+1.4↑	IF下季-当月	-48	-0.4↓
	IH当季-当月	-0.2	-1.2↓	IH下季-当月	5.2	-4.0↓
	IC当季-当月	-135.6	-13.2↓	IC下季-当月	-218.2	-12.0↓
IM当季-当月	-203.2		IM下季-当月	-353.2		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	20,406.00	-2133.0↓	IH前20名净持仓	-18,207	-1984.0↓
	IC前20名净持仓	-5,457.00	+775.0↑	IM前20名净持仓	-2314	-2063.0↓
现货价格	沪深300	4101.54	+34.6↑	IF主力合约基差	-10.5	-41.7↓
	上证50	2741.09	+30.4↑	IH主力合约基差	-0.9	-27.5↓
	中证500	6158.73	+34.4↑	IC主力合约基差	-34.3	-56.1↓
	中证1000	6960.31	+43.6↑	IM主力合约基差	-69.5	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	8,994.03	-2155.57↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,148.88	-30.08↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-10.49	-32.05↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-298.28	-96.77↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	78.23	+42.74↑	Shibor (日, %)	1.025	-0.001↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	64.00	+4.00↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.50	-9.47↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	70.80	-28.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.18	-10.70↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.09	+0.03↑	成交量PCR (%)	83.34	-5.26↓
				持仓量PCR (%)	58.10	-0.96↓
观点总结	全部A股	7.40	+3.60↑	技术面	7.80	+4.30↑
	资金面	7.00	+2.90↑			
重点关注的新闻	1、8月3日公布的7月财新中国通用服务业经营活动指数 (服务业PMI) 录得55.5, 较6月上升1.0个百分点, 连续第二个月位于扩张区间, 并且创2021年5月以来新高。7月服务业供给和需求继续回暖, 经营活动指数和新订单指数均在扩张区间小幅上升, 分别升至近15个月来和近九个月来最高。受调查企业反映, 最近防疫措施放宽支撑产出增长和客户需求改善。不过, 仍有部分企业表示经营活动继续受疫情限制。此外, 7月新出口订单指数在收缩区间回落, 显示外需仍相对较弱。					
	A股主要指数缩量上涨, 沪指收涨0.8%, 深指涨0.69%, 创业板指涨0.45%。四期指全线收涨, 上证50涨1.12%, 沪深300涨0.85%, 中证500涨0.56%, 中证1000涨0.63%。北向资金净卖出32.05亿。最近一周, 宏观政策针对扩大有效投资密集发力, 反复明确有效投资对稳经济的关键作用, 强调基建投资对稳增长政策发力的重要性, 向市场注入经济运行在合理区间, 下半年经济继续修复的信心。地缘政治事件持续影响投资者情绪, 事态后续发展或在后市加剧亚太股市波动, 但A股长期疫情修复逻辑不变。整体上A股回调逐渐企稳, 但短期波动仍将持续, 或需要一段时间整理; 中长期则仍有上升空间。技术面上, 中长线价值明确, 结合低估值以及疫情修复逻辑, 在稳增长政策发力下, 建议轻仓介入多IC合约。					
8-4 20: 30 美国7月30日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国6月贸易帐(亿美元)						
8-5 20: 30 美国7月失业率; 美国7月非农就业人口变动(万人)						



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!