

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)   | 4262.8     | +6.6↑    | IF次主力合约 (2209)     | 4225.6  | +7.4↑   |
|             | IH主力合约 (2208)   | 2864.0     | +2.8↑    | IH次主力合约 (2209)     | 2862.2  | +6.6↑   |
|             | IC主力合约 (2208)   | 6373.0     | +82.6↑   | IC次主力合约 (2209)     | 6266.0  | +90.8↑  |
|             | IF-IH当月合约价差   | 1398.8     | +4.4↑    | IC-IF当月合约价差        | 2110.2  | +77.0↑  |
|             |   |            |          | IC-IH当月合约价差        | 3509.0  | +81.4↑  |
|             | IF当季-当月   | -37.2      | -2.0↓    | IF下季-当月            | -53.6   | -1.0↓   |
|             | IH当季-当月   | -1.8       | +4.2↑    | IH下季-当月            | -3.4  | +2.8↑   |
|             | IC当季-当月   | -107.0     | +5.4↑    | IC下季-当月            | -182.8  | +9.4↑   |
| 期货持仓头寸 (净多) | IF前20名净持仓   | -18,350.00 | +466.0↑  | IH前20名净持仓          | -13,679   | +652.0↑ |
|             | IC前20名净持仓   | -11,493.00 | +886.0↑  |                    |   |         |
| 现货价格        | 沪深300   | 4283.80    | +14.5↑   | IF主力合约基差           | -21.0   | -29.6↓  |
|             | 上证50  | 2874.08    | +8.5↑    | IH主力合约基差           | -10.1   | -14.3↓  |
|             | 中证500   | 6410.71    | +75.0↑   | IC主力合约基差           | -37.7   | -123.3↓ |
| Wind市场强弱分析  | A股成交额 (日, 亿元)   | 9,524.73   | -442.89↓ | 两融余额 (前一交易日, 亿元)   | 16,243.35   | +2.31↑  |
|             | 陆股通 (昨日, 今日, 亿元)  | -98.59     | -77.96↓  | 逆回购 (到期量, 操作量, 亿元) | -30   | -30     |
|             | 主力资金 (昨日, 今日, 亿元)   | -288.92    | +36.78↑  | MLF (续作量, 净投放, 亿元) |   |         |
|             | 上涨股票比例 (日, %)   | 64.73      | -3.69↓   | Shibor (日, %)      | 1.270   | +0.028↑ |
| Wind市场强弱分析  | IO平值看涨期权收盘价 (2208)  | 75.80      | -2.80↓   | IO平值看涨期权隐含波动率 (%)  | 17.94   | -4.22↓  |
|             | IO平值看跌期权收盘价 (2208)  | 110.60     | -11.20↓  | IO平值看跌期权隐含波动率 (%)  | 17.90   | -5.19↓  |
|             | 沪深300指数20日波动率 (%)   | 17.13      | -0.55↓   | 成交量PCR (%)         | 73.36   | -0.42↓  |
|             |   |            |          | 持仓量PCR (%)         | 78.76   | +0.95↑  |
| Wind市场强弱分析  | 全部A股  | 6.70       | +0.40↑   | 技术面                | 6.50  | -0.30↓  |
|             | 资金面   | 7.00       | +1.20↑   |                    |   |         |
| 行业消息        | 1、7月20日, 中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布, 2022年7月20日贷款市场报价利率 (LPR) 为: 1年期LPR为3.7%, 5年期以上LPR为4.45%, 均与上期持平。  |            |          |                    |  <p>更多观点请咨询!</p> |         |
| 观点总结        | A股主要指数集体收涨。沪指收涨0.77%, 收复3300点, 深指涨0.63%, 创业板指收涨0.52%。三期指飘红, 上证50微涨0.1%, 沪深300涨0.16%, 中证500涨1.31%。北向资金净流入, 达36.78亿。今日央行公布最新利率, 1年期LPR为3.7%, 5年期以上LPR为4.45%, 均与上期持平。在MLF利率未调整、商业银行净息差承压的背景下, LPR按兵不动符合市场预期, 但企业综合融资成本仍稳中有降, 释放稳增长的复苏信号。昨日针对多支高位人气个股出现的券商风险提示和交易所关注函引发的闪跌延续到今日, 短线投机情绪受到影响。整体上看, A股回调逐渐企稳, 中长期仍有上升空间。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。 |            |          |                    |  <p>更多资讯请关注!</p> |         |
| 重点关注        | 7-20 22: 00 美国6月成屋销售总数年化(万户);<br>7-21 20: 30 美国7月16日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国7月16日当周首次申请失业救济人数(万人)   |            |          |                    |   |         |