

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)	4142.6	-8.2↓	IF次主力合约 (2209)	4109.8	-7.6↓
	IH主力合约 (2208)	2761.8	-10.8↓	IH次主力合约 (2209)	2763.4	-10.6↓
	IC主力合约 (2208)	6291.4	+48.2↑	IC次主力合约 (2209)	6158.2	+49.6↑
	IM主力合约 (2208)	7132.2	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	6922.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1380.8	+1.0↑	IC-IF当月合约价差	2148.8	+47.6↑
	IM-IC当月合约价差	840.8		IC-IH当月合约价差	3529.6	+48.6↑
	IM-IF当月合约价差	2989.6		IM-IH当月合约价差	4370.4	
	IF当季-当月	-32.8	-0.2↓	IF下季-当月	-47.2	+0.2↑
	IH当季-当月	1.6	-1.4↓	IH下季-当月	7.2	+4.0↑
	IC当季-当月	-133.2	-0.6↓	IC下季-当月	-221	+0.8↑
IM当季-当月	-210.2		IM下季-当月	-362.2		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-14,647.00	-300.0↓	IH前20名净持仓	-16,989	-224.0↓
	IC前20名净持仓	-4,761.00	+604.0↑	IM前20名净持仓	-2569	-386.0↓
现货价格	沪深300	4148.07	-8.8↓	IF主力合约基差	-5.5	+8.7↑
	上证50	2761.16	-13.2↓	IH主力合约基差	0.6	+15.8↑
	中证500	6323.07	+52.6↑	IC主力合约基差	-31.7	-65.1↓
	中证1000	7176.11	+86.1↑	IM主力合约基差	-43.9	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,525.97	-427.98↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,198.24	+10.28↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+29.34	-10.75↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+83.18	-58.85↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	81.46	+9.90↑	Shibor (日, %)	1.013	-0.006↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	49.00	-9.00↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	16.44	-1.05↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	59.00	+4.40↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.39	+3.31↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.51	-0.87↓	成交量PCR (%)	85.69	-1.11↓
				持仓量PCR (%)	62.62	+5.03↑
观点总结	全部A股	6.90	-0.40↓	技术面	7.20	+0.10↑
	资金面	6.70	-0.80↓			
重点关注的	1、海关总署: 今年前7个月我国外贸进出口总值23.6万亿元, 同比增长10.4%。其中, 出口13.37万亿元, 增长14.7%; 进口10.23万亿元, 增长5.3%; 贸易顺差3.14万亿元, 扩大62.1%。前7个月我国有进出口实绩外贸企业数量52.6万家, 同比增加5.8%。其中, 民营企业进出口11.8万亿元, 增长15.3%, 占我国外贸总值50%					
	A股主要指数涨跌分化, 沪指收涨0.31%, 深指涨0.27%, 创业板指跌0.29%。四期指走势形成分化, 上证50跌0.47%, 沪深300跌0.21%, 中证500涨0.84%, 中证1000涨1.21%。北向资金净卖出10.75亿。基本上, 外贸数据显示, 当前出口增速超预期, 出口维持韧性短期对经济的拉动作用或仍较为显著, 而随着海外经济体需求回落, 外贸增速维持高位或难具有持续性, 内需修复程度依然是经济修复的关键因素。近期, 市场逐步进入弱势震荡格局, 成交量有所萎缩, 经济复苏预期的弱化使得资金情绪降温, 建议短线上投资者以波段操作为主, 中长线上关注稳增长政策主导下的“基建”发力领域。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。					
8-9 待定 中国7月M0货币供应同比; 中国7月M1货币供应同比; 中国7月M2货币供应同比; 中国7月新增人民币贷款(亿人民币); 中国7月社会融资规模增量(亿人民币)						
8-10 09: 30 中国7月CPI同比; 中国7月PPI同比; 20: 30 美国7月核心CPI同比; 美国7月CPI同比; 美国7月核心CPI环比; 美国7月CPI环比; 22: 30 国8月5日当周EIA原油库存变动(万桶)						
8-11 20: 30 美国7月PPI同比; 美国7月核心PPI环比; 美国7月PPI环比; 美国7月核心PPI同比						



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!