

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)	4149.2	+5.8↑	IF次主力合约 (2209)	4114.0	+4.6↑
	IH主力合约 (2208)	2761.4	+0.8↑	IH次主力合约 (2209)	2762.6	+0.2↑
	IC主力合约 (2208)	6309.4	+15.4↑	IC次主力合约 (2209)	6174.6	+16.2↑
	IM主力合约 (2208)	7160.6	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	6940.4	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1387.8	+7.0↑	IC-IF当月合约价差	2160.2	+11.4↑
	IM-IC当月合约价差	851.2		IC-IH当月合约价差	3548.0	+18.4↑
	IM-IF当月合约价差	3011.4		IM-IH当月合约价差	4399.2	
	IF当季-当月	-35.2	-2.4↓	IF下季-当月	-51.6	-4.4↓
	IH当季-当月	1.2	-0.4↓	IH下季-当月	7.4	+0.2↑
	IC当季-当月	-134.8	-1.6↓	IC下季-当月	-221	0.0
IM当季-当月	-220.2		IM下季-当月	-371.6		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-16,571.00	+1076.0↑	IH前20名净持仓	-16,501	+488.0↑
	IC前20名净持仓	-4,722.00	+39.0↑	IM前20名净持仓	-450	+2119.0↑
现货价格	沪深300	4156.29	+8.2↑	IF主力合约基差	-7.1	-13.7↓
	上证50	2764.07	+2.9↑	IH主力合约基差	-2.7	-2.3↓
	中证500	6341.48	+18.4↑	IC主力合约基差	-32.1	-50.1↓
	中证1000	7207.40	+31.3↑	IM主力合约基差	-46.8	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,530.03	+4.06↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,245.64	+47.40↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-10.75	-22.12↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-400	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-58.85	-121.78↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	72.16	-9.30↓	Shibor (日, %)	1.018	+0.005↑
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	48.60	-0.40↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	16.57	-1.32↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	51.40	-7.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	16.67	-3.13↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.34	-0.17↓	成交量PCR (%)	76.26	-9.43↓
				持仓量PCR (%)	64.08	+1.46↑
观点总结	全部A股	5.40	-1.50↓	技术面	4.50	-2.70↓
	资金面	6.40	-0.30↓			
重点关注的	1、乘联会: 2022年7月乘用车市场零售达到181.8万辆, 同比增长20.4%, 是以往10年的次高增速; 7月零售环比下降6.5%, 环比增速处于近10年同期历史第3高位。1-7月累计零售1107.9万辆, 同比下降3.5%, 同比减少41万辆, 其中6-7月同比增加68万辆的增量贡献较大。					
	A股主要指数涨跌分化, A股低开后震荡攀升, 午后横盘震荡; 沪指、深成指实现四连阳, 创业板指三连阳。四期指均小幅收涨。北向资金净卖出22.12亿。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!