

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)	4206.6	-17.4↓	IF次主力合约 (2209)	4172.6	-17.0↓
	IH主力合约 (2208)	2840.0	-11.0↓	IH次主力合约 (2209)	2838.0	-11.2↓
	IC主力合约 (2208)	6173.6	-59.6↓	IC次主力合约 (2209)	6044.2	-64.8↓
	IF-IH当月合约价差	1366.6	-8.8↓	IC-IF当月合约价差	1967.0	-53.6↓
				IC-IH当月合约价差	3333.6	-62.4↓
	IF当季-当月	-34.0	+0.2↑	IF下季-当月	-54.8	-0.8↓
	IH当季-当月	-2.0	-3.6↓	IH下季-当月	-0.4	-3.4↓
	IC当季-当月	-129.4	-9.8↓	IC下季-当月	-208.4	-15.6↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,055.00	-324.0↓	IH前20名净持仓	-15,584	-1337.0↓
	IC前20名净持仓	-11,255.00	+2421.0↑			
现货价格	沪深300	4212.64	-25.6↓	IF主力合约基差	-6.0	+11.6↑
	上证50	2837.26	-11.2↓	IH主力合约基差	2.7	+11.5↑
	中证500	6231.24	-58.3↓	IC主力合约基差	-57.6	+13.6↑
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	8,621.77	-792.38↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,267.49	-25.01↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-16.45	-33.85↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-120	+50
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-368.67	-381.50↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	30.49	-8.50↓	Shibor (日, %)	1.074	-0.120↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	89.60	-9.40↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	18.39	+4.00↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	82.80	+9.40↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.35	+3.12↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.96	-0.71↓	成交量PCR (%)	92.05	+0.60↑
				持仓量PCR (%)	68.77	-3.61↓
观点总结	全部A股	3.60	-0.60↓	技术面	3.00	-0.90↓
	资金面	4.10	-0.40↓			
重点关注的	1、7月22日召开的国务院常务会议, 会议指出, 我国经济正处于企稳回升关键窗口, 三季度至关重要。要贯彻党中央、国务院部署, 高效统筹疫情防控和经济社会发展, 推动稳经济一揽子政策进一步生效, 下大力气巩固经济恢复基础, 着力稳定宏观经济大盘, 保持经济运行在合理区间, 优先保障稳就业稳物价目标实现。政策性开发性金融工具等政策效能释放还有相当大空间, 并能撬动大量社会资金, 要以市场化方式用好, 更好发挥有效投资补短板调结构、稳就业带消费综合效应和对经济恢复发展关键性作用。					
	A股主要指数午后水下震荡, 缩量下跌。沪指收跌0.6%, 深指跌0.83%, 创业板指收跌1.18%。四期指收跌, 上证50跌0.39%, 沪深300跌0.6%, 中证500跌0.93%, 中证1000跌1.22。北向资金净流出33.85亿。最高人民法院发布《关于为加快建设全国统一大市场提供司法服务和保障的意见》。其中提出, 支持发展统一的资本市场。依法严惩操纵市场、内幕交易等金融领域犯罪, 继续影响个股情绪面。海关总署发布关于防止猴痘疫情传入我国的公告, 猴痘概念板块成为新热点。近期板块轮动快速, 个股情绪面降低, 市场波动较大, 建议投资者逢低位布局。而经济恢复速度放慢, 力度偏弱则有更可能进一步加强市场分化, 整体上看, A股短期波动仍将持续, 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。					
	7-26 22:00 美国6月新屋销售(万户);美国7月谘商会消费者信心指数 7-27 20:30 美国6月扣除飞机非国防资本耐用品订单环比初值;美国6月耐用品订单环比初值;美国6月商品贸易帐(亿美元);美国6月成屋签约销售指数同比 7-28 02:00 美国FOMC利率决策(上限);美国FOMC利率决策(下限); 02: 30 美联储主席鲍威尔召开货币政策新闻发布会					

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!

备注: IF:沪深300 IH:上证50 IC:中证500 IO:沪深300期权