

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)	4101.4	-45.8↓	IF次主力合约 (2209)	4069.6	-43.8↓
	IH主力合约 (2208)	2727.6	-34.2↓	IH次主力合约 (2209)	2729.8	-33.2↓
	IC主力合约 (2208)	6291.0	-16.4↓	IC次主力合约 (2209)	6156.0	-13.6↓
	IM主力合约 (2208)	7168.4	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	6950.8	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1373.8	-14.0↓	IC-IF当月合约价差	2189.6	+29.4↑
	IM-IC当月合约价差	877.4		IC-IH当月合约价差	3563.4	+15.4↑
	IM-IF当月合约价差	3067.0		IM-IH当月合约价差	4440.8	
	IF当季-当月	-31.8	+3.4↑	IF下季-当月	-46	+5.6↑
	IH当季-当月	2.2	+1.0↑	IH下季-当月	7.4	0.0
	IC当季-当月	-135.0	-0.2↓	IC下季-当月	-220	+1.0↑
IM当季-当月	-217.6		IM下季-当月	-372.4		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-17,053.00	-482.0↓	IH前20名净持仓	-16,917	-416.0↓
	IC前20名净持仓	-4,873.00	-151.0↓	IM前20名净持仓	-2608	-2158.0↓
现货价格	沪深300	4109.74	-46.6↓	IF主力合约基差	-8.3	+39.5↑
	上证50	2730.96	-33.1↓	IH主力合约基差	-3.4	+30.4↑
	中证500	6322.06	-19.4↓	IC主力合约基差	-31.1	-12.7↓
	中证1000	7212.08	+4.7↑	IM主力合约基差	-43.7	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)	16,298.28	+52.64↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-22.12	-62.36↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-121.78	-298.12↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	46.61	-25.55↓	Shibor (日, %)	1.068	+0.050↑
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	51.20	-20.20↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	17.60	+3.49↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	47.20	+16.20↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.75	+3.78↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.65	+0.31↑	成交量PCR (%)	78.43	+2.17↑
				持仓量PCR (%)	64.21	+0.13↑
观点总结	全部A股	4.50	-0.90↓	技术面	4.70	+0.20↑
	资金面	4.30	-2.10↓			
重点关注	1、国家统计局: 7月份, 全国居民消费价格同比上涨2.7%。其中, 城市上涨2.6%, 农村上涨3.0%; 食品价格上涨6.3%, 非食品价格上涨1.9%; 消费品价格上涨4.0%, 服务价格上涨0.7%。7月份, 全国工业生产者出厂价格同比上涨4.2%, 环比下降1.3%; 工业生产者购进价格同比上涨6.5%, 环比下降0.9%。1—7月平均, 工业生产者出厂价格比去年同期上涨7.2%, 工业生产者购进价格上涨9.8%。					
	A股主要指数多数收跌, A股早盘震荡走低; 沪指收跌0.54%, 深证成指收跌0.87%, 创业板指收跌1.34%。四期指中除了中证1000小幅收涨以外均以收跌为主。北向资金净卖出62.36亿。猪价显著上涨引领CPI进一步上行, 下半年预计通胀存在一定走升压力。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。					
	8-10 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 美国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 8-12 22: 00 美国8月密歇根大学消费者信心指数初值					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!