

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)	4173.0	-12.2↓	IF次主力合约 (2209)	4149.2	-10.6↓
	IH主力合约 (2208)	2766.8	-16.4↓	IH次主力合约 (2209)	2775.4	-15.4↓
	IC主力合约 (2208)	6454.0	+24.0↑	IC次主力合约 (2209)	6322.2	+22.0↑
	IM主力合约 (2208)	7311.0	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	7103.2	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1406.2	+5.4↑	IC-IF当月合约价差	2281.0	+34.8↑
	IM-IC当月合约价差	857.0		IC-IH当月合约价差	3687.2	+40.2↑
	IM-IF当月合约价差	3138.0		IM-IH当月合约价差	4544.2	
	IF当季-当月	-23.8	+2.8↑	IF下季-当月	-41.4	+0.8↑
	IH当季-当月	8.6	+0.6↑	IH下季-当月	13.2	+1.6↑
	IC当季-当月	-131.8	-0.8↓	IC下季-当月	-222.2	-0.2↓
IM当季-当月	-207.8		IM下季-当月	-366		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-18,352.00	-1521.0↓	IH前20名净持仓	-19,406	-1333.0↓
	IC前20名净持仓	-6,538.00	+3499.0↑	IM前20名净持仓	-1944	-638.0↓
现货价格	沪深300	4177.84	-7.8↓	IF主力合约基差	-4.8	+5.0↑
	上证50	2769.26	-13.4↓	IH主力合约基差	-2.5	+12.7↑
	中证500	6465.19	+22.4↑	IC主力合约基差	-11.2	-36.2↓
	中证1000	7324.62	+41.1↑	IM主力合约基差	-13.6	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,763.09	-232.28↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,348.85	+51.38↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+10.87	+8.67	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-115.57	-196.99	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	58.06	+10.92↑	Shibor (日, %)	1.043	-0.001↓
观点总结	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	16.20	-8.40↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	14.80	-1.15↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	42.80	+1.80↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	14.74	-1.20↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	15.02	-0.09↓	成交量PCR (%)	69.03	-2.71↓
				持仓量PCR (%)	66.23	-1.34↓
Wind市场强弱分析	全部A股	6.00	+0.50↑	技术面	5.80	+1.10↑
	资金面	6.20	-0.10↓			
行业消息	1、8月15日, 央行公告称, 为维护银行体系流动性合理充裕, 8月15日开展4000亿元中期借贷便利 (MLF) 操作(含对8月16日MLF到期的续做)和20亿元公开市场逆回购操作, 充分满足了金融机构需求。中期借贷便利 (MLF) 操作和公开市场逆回购操作的中标利率分别为2.75%、2.0%, 均下降10个基点。					
观点总结	A股主要指数走势分化沪指、深成指早盘震荡上扬, 午后涨幅回落, 尾盘勉强翻红; 创业板指表现相对强势, 盘中上涨超1%, 午后涨幅收窄。截至收盘, 沪指微涨0.05%, 深成指涨0.08%, 创业板指涨0.47%。四期指亦形成分化走势, 沪深300以及上证50代表的大盘蓝筹走弱, 中证500以及中证1000代表的中小盘收涨。北向资金小幅净流入8.67亿元。近期A股行情表现为, 热点轮动较快, 市场缺乏主线, 蓝筹表现相对低迷, 中小市值活跃度较高。当前宏观层面面临的阶段性不确定性和挑战较多有关, 然结合央行二季度货币政策报告以及最新社融数据来看, 宏观流动性仍以宽松为主, 流动性充裕对市场有一定支持。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。					
重点关注	8-16 20: 30 美国7月新屋开工(万户); 美国7月营建许可(万户) 8-17 20: 30 美国7月零售销售环比; 22: 30 美国8月12日当周EIA原油库存变动(万桶)					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!