

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)	4214.2	+39.0↑	IF次主力合约 (2209)	4188.0	+36.2↑
	IH主力合约 (2208)	2783.6	+15.0↑	IH次主力合约 (2209)	2790.0	+15.0↑
	IC主力合约 (2208)	6492.4	+36.6↑	IC次主力合约 (2209)	6361.2	+35.4↑
	IM主力合约 (2208)	7327.6	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	7127.2	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1430.6	+24.4↑	IC-IF当月合约价差	2278.2	-2.8↓
	IM-IC当月合约价差	835.2		IC-IH当月合约价差	3708.8	+21.6↑
	IM-IF当月合约价差	3113.4		IM-IH当月合约价差	4544.0	
	IF当季-当月	-26.2	-2.4↓	IF下季-当月	-43	-1.6↓
	IH当季-当月	6.4	-2.2↓	IH下季-当月	13	-0.2↓
	IC当季-当月	-131.2	+0.6↑	IC下季-当月	-218.4	+3.8↑
IM当季-当月	-200.4		IM下季-当月	-358.6		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-16,050.00	+2302.0↑	IH前20名净持仓	-18,480	+926.0↑
	IC前20名净持仓	-5,028.00	+1510.0↑	IM前20名净持仓	-2550	-606.0↓
现货价格	沪深300	4216.96	+39.1↑	IF主力合约基差	-2.8	-44.0↓
	上证50	2785.85	+16.6↑	IH主力合约基差	-2.3	-19.0↓
	中证500	6493.50	+28.3↑	IC主力合约基差	-1.1	-39.5↓
	中证1000	7328.67	+4.1↑	IM主力合约基差	-1.1	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,744.49	+981.40↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,385.82	+36.97↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+8.67	+68.72↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-196.99	-154.38↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	57.15	-0.91↓	Shibor (日, %)	1.138	+0.095↑
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	29.40	+13.20↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	14.38	-2.86↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	16.00	-26.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	14.51	-1.54↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	15.40	+0.39↑	成交量PCR (%)	68.67	-0.36↓
				持仓量PCR (%)	70.42	+4.69↑
观点总结	全部A股	5.90	-0.10↓	技术面	5.10	-0.70↓
	资金面	6.70	+0.50↑			
重点关注的新闻	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。					
	A股主要指数震荡上行, 市场成交量放大。沪深两市早盘探底回升, 创业板指表现相对强势。截至收盘, 沪指涨0.45%, 深成指涨1.01%, 创业板指涨1.7%。四期指齐收涨, 沪深300以及上证50代表的大盘相对强势, 中证500以及中证1000代表的中小盘收小幅收涨。北向资金大幅净流入68.72亿元。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。					
重点关注的新闻	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)					
	8-18 02: 00 美联储FOMC公布7月货币政策会议纪要; 20: 30 美国8月13日当周首次申请失业救济人数(万人); 22: 30 美国7月成屋销售总数年化(万户)					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!