

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)	4109.4	-62.2↓	IF次主力合约 (2209)	4074.4	-60.6↓
	IH主力合约 (2208)	2731.8	-44.6↓	IH次主力合约 (2209)	2733.0	-43.2↓
	IC主力合约 (2208)	6167.4	-140.0↓	IC次主力合约 (2209)	6055.0	-115.2↓
	IM主力合约 (2208)	6948.2	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	6767.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1377.6	-18.4↓	IC-IF当月合约价差	2058.0	-79.4↓
	IM-IC当月合约价差	780.8		IC-IH当月合约价差	3435.6	-97.8↓
	IM-IF当月合约价差	2838.8		IM-IH当月合约价差	4216.4	
	IF当季-当月	-35.0	+2.8↑	IF下季-当月	-55.4	+2.8↑
	IH当季-当月	1.2	+0.8↑	IH下季-当月	3.2	+2.2↑
	IC当季-当月	-112.4	+23.6↑	IC下季-当月	-204	+15.2↑
IM当季-当月	-181.2		IM下季-当月	-336.2		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-16,806.00	-507.0↓	IH前20名净持仓	-16,870	-476.0↓
	IC前20名净持仓	-3,936.00	+4547.0↑	IM前20名净持仓	-450	-413.0↓
现货价格	沪深300	4107.02	-81.7↓	IF主力合约基差	2.4	+67.0↑
	上证50	2730.76	-50.9↓	IH主力合约基差	1.0	+47.2↑
	中证500	6170.00	-177.2↓	IC主力合约基差	-2.6	+141.4↑
	中证1000	6957.98	-222.5↓	IM主力合约基差	-9.8	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	11,811.25	+1872.64↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,315.75	+41.03↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+29.98	-23.11↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-50	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-62.20	-834.78↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	8.20	-44.22↓	Shibor (日, %)	1.076	-0.101↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	93.20	-26.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	23.88	+23.21↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	88.20	+41.00↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	23.98	+20.33↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.06	+1.17↑	成交量PCR (%)	102.09	+7.22↑
				持仓量PCR (%)	64.25	-1.81↓
观点总结	全部A股	2.10	-3.90↓	技术面	0.80	-4.40↓
	资金面	3.40	-3.40↓			
重点关注的新闻	1、8月1日, 央行召开2022年下半年工作会议, 强调要保持货币信贷平稳适度增长, 综合运用多种货币政策工具, 保持流动性合理充裕; 引导金融机构增加对实体经济的贷款投放, 保持贷款持续平稳增长; 引导实际贷款利率稳中有降。稳妥化解重点领域风险, 因城施策实施好差别化住房信贷政策; 保持房地产信贷、债券等融资渠道稳定, 加快探索房地产新发展模式。开展宏观审慎压力测试, 出台系统重要性保险公司评估办法, 对金融控股公司开展全方位监管。加快推动柜台债券市场发展, 统一银行间和交易所债券市场对外开放资金管理政策。稳步提升人民币国际化水平, 夯实贸易投资人民币结算的市场基础; 支持境外主体发行“熊猫债”, 稳步推动“互换通”启动工作, 提高人民币金融资产的流动性。					
	A股主要指数放量下跌, 截止收盘, 沪指收跌2.26%, 深指跌2.37%, 创业板指跌2.02%。四期指全线收跌, 上证50跌1.83%, 沪深300跌1.95%, 中证500跌2.79%, 中证1000跌3.1%, 中小盘股下跌幅度较大。北向资金净卖出23.11亿。上周PMI数据出炉, 不及预期, 或释放复苏放缓信号。昨日央行召开2022年下半年工作会议, 强调要保持货币信贷平稳适度增长, 综合运用多种货币政策工具, 保持流动性合理充裕; 引导金融机构增加对实体经济的贷款投放, 保持贷款持续平稳增长; 引导实际贷款利率稳中有降。海外市场方面, 随着美联储加息落地, 海外市场对继续加息预期降低, 波动因素或将边际减弱。今日消息面上, 地缘政治风险因素使得开盘后即引发恐慌性抛售和外资流出, 疲弱情绪延续到收盘, 事态后续发展或在后市继续影响亚太股市波动, 但A股长期疫情修复逻辑不变。整体上A股回调逐渐企稳, 但短期波动仍将持续, 或需要一段时间整理; 中长期则仍有上升空间。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。					
重点关注的新闻	8-2 22: 00美国芝加哥联储主席埃文斯主持媒体早餐会, 讨论美国经济和货币政策					
	8-3 9: 45 中国7月财新服务业PMI; 中国7月财新综合PMI; 22: 00 美国7月ISM非制造业指数; 美国6月扣除飞机非国防资本耐用品订单环比终值; 美国6月耐用品订单环比终值; 22: 30 美国7月29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!

瑞达研究