

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 (2210)	3841.4	-24.2↓	IF次主力合约 (2212)	3835.8	-22.4↓
	IH主力合约 (2210)	2615.0	-19.6↓	IH次主力合约 (2212)	2623.4	-20.2↓
	IC主力合约 (2210)	5804.4	-79.0↓	IC次主力合约 (2212)	5749.8	-75.0↓
	IM主力合约 (2210)	6255.0	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6159.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1226.4	-6.0↓	IC-IF当月合约价差	1963.0	-46.0↓
	IM-IC当月合约价差	450.6	+0.6↑	IC-IH当月合约价差	3189.4	-52.0↓
	IM-IF当月合约价差	2413.6	-45.4↓	IM-IH当月合约价差	3640.0	-51.4↓
	IF当季-当月	-5.6	+1.8↑	IF下季-当月	-12.6	+1.8↑
	IH当季-当月	8.4	-2.4↓	IH下季-当月	23	-2.4↓
	IC当季-当月	-54.6	+1.8↑	IC下季-当月	-143.4	-7.0↓
IM当季-当月	-96.0	+4.8↑	IM下季-当月	-219.8	+9.2↑	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,411.00	+2483.0↑	IH前20名净持仓	-25,627	-2104.0↓
	IC前20名净持仓	4,389.00	+1623.0↑	IM前20名净持仓	-1893	+675.0↑
现货价格	沪深300	3836.68	-19.3↓	IF主力合约基差	4.7	+8.4↑
	上证50	2614.90	-14.9↓	IH主力合约基差	0.1	+2.2↑
	中证500	5806.32	-83.3↓	IC主力合约基差	-1.9	-16.2↓
	中证1000	6283.59	-80.1↓	IM主力合约基差	-28.6	-40.3↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	6,679.54	+4.13↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,791.92	-117.66↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-5.06	+42.77↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+1350
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-291.54	-138.78↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	18.68	+7.08↑	Shibor (日, %)	1.429	-0.036↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2210)	74.60	-8.00↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	20.94	+7.89↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2210)	82.20	+15.20↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	21.57	+10.37↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	12.38	+0.01↑	成交量PCR (%)	91.03	+6.22↑
				持仓量PCR (%)	73.17	-1.19↓
观点总结	全部A股	2.90	+0.30↑	技术面	1.90	+0.80↑
	资金面	4.00	+0.10↑			
重点关注的	1、9月26日, 央行表示, 为稳定外汇市场预期, 加强宏观审慎管理, 决定自2022年9月28日起, 将远期售汇业务的外汇风险准备金率从0上调至20%。					
	2、9月23日, 上周五, 银保监会相关部门负责人介绍目前防范化解重点领域相关风险的工作进展时表示: “房地产金融化泡沫化势头得到实质性扭转。”此外, 在济南、昆明、大连之后, 又有一个特大城市全面放开落户。日前, 郑州发布新政, 拟进一步放宽中心城区落户条件。					
	A股主要指数走势分化。沪指盘中一度翻红, 午后大幅下探。截至收盘, 沪指跌1.2%, 深成指涨0.4%, 创业板指涨0.83%。四期指均收跌, 中证500以及中证1000表现较弱, 收跌超过1%。短期看, 市场成交量或难以恢复。随着地缘政治风险升级, 以及国庆长假的来临, 预计本周市场在缺乏重大利好面的情况下依然维持弱势震荡格局。静待十月份二十大政策定调, 提振市场整体做多情绪, 引领增量资金入市。中长线上, 历史复盘来看, 本轮回撤幅度以及时间区间已经接近历史平均水平, 结合当前指数估值仍处于低位, 预计大盘下行空间有限。技术面上, 指数中长线价值明确, 结合低估值以及疫情修复逻辑, 以及海内外风险放大的背景下, 大盘后续倾向均衡风格, 建议轻仓介入多IF空IM合约。					
重点关注的	9-27 20: 30 美国8月耐用品订单环比初值; 22: 00 美国8月新屋销售(万户) ; 美国9月谘商会消费者信心指数					
	9-28 20: 30 美国8月商品贸易帐(亿美元); 22: 00 美国8月成屋签约销售指数同比; 22: 30 美国9月23日当周EIA原油库存变动(万桶)					
	9-29 20: 30 美国二季度个人消费支出(PCE)年化季环比终值; 美国二季度实际GDP年化季环比终值 ; 美国9月24日当周首次申请失业救济人数(万人)					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!