

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)	3835.4	-4.4↓	IF次主力合约 (2212)	3827.0	-10.4↓
	IH主力合约 (2210)	2566.6	-14.4↓	IH次主力合约 (2212)	2570.8	-15.2↓
	IC主力合约 (2210)	6035.2	+16.8↑	IC次主力合约 (2212)	5994.8	+12.6↑
	IM主力合约 (2210)	6497.2	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6395.4	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1268.8	+11.8↑	IC-IF当月合约价差	2199.8	+34.8↑
	IM-IC当月合约价差	462.0	+16.4↑	IC-IH当月合约价差	3468.6	+46.6↑
	IM-IF当月合约价差	2661.8	+51.2↑	IM-IH当月合约价差	3930.6	+63.0↑
	IF当季-当月	-8.4	-6.2↓	IF下季-当月	-16.4	-9.6↓
	IH当季-当月	4.2	+0.2↑	IH下季-当月	14.6	-1.2↓
	IC当季-当月	-40.4	-3.2↓	IC下季-当月	-120	-5.6↓
IM当季-当月	-101.8	-14.2↓	IM下季-当月	-243.2	-15.2↓	
期货持仓寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,722.00	+342.0↑	IH前20名净持仓	-26,325	-694.0↓
	IC前20名净持仓	8,788.00	+2917.0↑	IM前20名净持仓	-1824	+1456.0↑
现货价格	沪深300	3838.27	-8.2↓	IF主力合约基差	-2.9	-9.0↓
	上证50	2569.97	-15.5↓	IH主力合约基差	-3.4	-5.1↓
	中证500	6035.67	+20.1↑	IC主力合约基差	-0.5	-13.2↓
	中证1000	6508.50	+36.1↑	IM主力合约基差	-11.3	-24.4↓
Wind市场强 弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	7,938.03	-134.75↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,486.96	+32.64↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-44.25	-123.82↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-124.53	-37.57↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	43.82	-35.71↓	Shibor (日, %)	1.134	-0.033↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2210)	22.00	-6.60↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	17.82	+6.34↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2210)	40.20	+2.00↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.58	+3.97↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	18.47	-0.19↓	成交量PCR (%)	69.83	-2.65↓
				持仓量PCR (%)	61.18	+0.18↑
观点总结	全部A股	5.10	-2.30↓	技术面	4.40	-3.60↓
	资金面	5.90	-0.90↓			
重点关注的	1、央行10月17日开展5000亿元MLF操作, 实现等量平价续做, 结束此前连续两个月的缩量操作。专家表示, 10月MLF等量平价续作表明在内外因素综合考量下, 当前央行既不会大幅收紧流动性, 也难以在量的层面过度支持流动性。当前市场流动性充足, 10月份LPR报价下降的可能性偏低, 但也不排除5年期以上LPR报价单独下降的可能。					
	A股主要指数涨跌不一。沪指盘中一度冲击3100点, 随后震荡翻绿; 深成指、创业板指尾盘涨幅明显收窄。四期指走势分化, 中证500以及中证1000收涨, 沪深300以及上证50收跌。沪深两市成交量下降, 北向资金大幅净流出。党第二十次全国代表大会16日上午在人民大会堂开幕, 提出未来五年是全面建设社会主义现代化国家开局起步的关键时期。从当前全球资本环境来看, 海外风险因素尚未完全落地, 经济衰退预期叠加通胀风险使得美股难以延续反弹走势, 美股表现反复。关注国内市场可能跟随调整的风险。中长线来看, 当前A股估值已经调整至低估区域, 并且随着市场逐步消化悲观情绪, 后续指数有望延续上行趋势。技术面上, 市场风格或向均衡方向倾斜, 可选择区间低配操作或轻仓介入多IF空IM合约。					
10-19 20: 30 美国9月新屋开工(万户); 美国10月14日当周EIA原油库存变动(万桶) 10-20 09: 15 中国10月五年期贷款市场报价利率(LPR); 中国10月一年期贷款市场报价利率(LPR); 22: 00 美国9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!