

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 (2209)	4068.8	-47.0↓	IF次主力合约 (2212)	4059.6	-46.2↓
	IH主力合约 (2209)	2749.8	-24.0↓	IH次主力合约 (2212)	2758.8	-23.6↓
	IC主力合约 (2209)	6252.8	-43.8↓	IC次主力合约 (2212)	6166.0	-41.4↓
	IM主力合约 (2209)	6826.0	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6663.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1319.0	-22.8↓	IC-IF当月合约价差	2184.0	+0.6↑
	IM-IC当月合约价差	573.2	-25.6↓	IC-IH当月合约价差	3503.0	-22.2↓
	IM-IF当月合约价差	2757.2	-25.0↓	IM-IH当月合约价差	4076.2	-47.8↓
	IF当季-当月	-9.2	+1.2↑	IF下季-当月	-20.4	-1.0↓
	IH当季-当月	9.0	-0.6↓	IH下季-当月	22.6	-1.0↓
	IC当季-当月	-86.8	-1.2↓	IC下季-当月	-178.6	+3.8↑
IM当季-当月	-163.0	-3.6↓	IM下季-当月	-316.2	-8.2↓	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-22,990.00	-1601.0↓	IH前20名净持仓	-27,817	-2192.0↓
	IC前20名净持仓	114.00	+911.0↑	IM前20名净持仓	-2127	+2085.0↑
现货价格	沪深300	4065.36	-45.8↓	IF主力合约基差	3.4	-1.9↓
	上证50	2745.43	-23.8↓	IH主力合约基差	4.4	-1.8↓
	中证500	6249.96	-50.5↓	IC主力合约基差	2.8	-7.8↓
	中证1000	6829.56	-74.5↓	IM主力合约基差	-3.6	-12.7↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	7,227.27	-486.24↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,065.61	+28.02↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+39.71	-14.14↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-176.20	-301.94↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	23.47	-28.90↓	Shibor (日, %)	1.173	+0.002↑
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2209)	30.00	-36.00↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	13.44	+4.96↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2209)	12.00	+7.20↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	13.36	+0.70↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	12.87	+0.52↑	成交量PCR (%)	82.91	+7.40↑
				持仓量PCR (%)	62.25	-4.86↓
观点总结	全部A股	3.20	-2.50↓	技术面	2.30	-2.90↓
	资金面	4.00	-2.10↓			
重点关注的	1、9月14日, 据中国汽车工业协会统计分析, 2022年8月, 汽车出口再创历史新高, 历史上首次超过30万辆。2022年8月, 汽车出口30.8万辆, 环比增长6.2%, 同比增长65%。2022年1-8月, 汽车企业出口181.7万辆, 同比增长52.8%。					
	A股主要指数收跌, 两市成交量继续萎缩。两市股指集体低开, 盘中弱势震荡下探。截至收盘, 沪指跌0.8%, 深成指跌1.25%, 创业板指跌1.84%。四期指均下行, 沪深300以及中证1000收跌超过1%。北向资金小幅净流出。美国8月通胀数据公布, 美国8月CPI同比升8.3%, 预期升8.1%, 前值升8.5%。美国8月通胀数据超出市场预期, 核心CPI再度走高, 预示着9月美联储加息75BP的概率进一步加大, 隔夜美股大幅下行, 全球市场风险偏好受到打击。国内方面, 结合政策和基本面来看, 最近4次国常会对于政策的表态相对积极, 主基调仍是传递托底经济的信号。而从中报业绩看, 当前A股盈利预期处于底部修复周期, 全A净利润降幅收窄, 亦呈现的是相对积极的信号, 市场不宜过分悲观。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, 在宏观经济数据出炉后的可能政策发力下, 建议轻仓介入多IC/IM合约。					
9-14 20: 30 美国8月PPI同比; 美国8月核心PPI环比; 美国8月PPI环比; 美国8月核心PPI同比; 22: 30 美国9月9日当周EIA原油库存变动(万桶)						
9-15 20: 30 美国8月零售销售环比; 美国9月10日当周首次申请失业救济人数(万人)						
9-16 10: 00 中国1至8月全国房地产开发投资; 中国1至8月城镇固定资产投资同比; 中国1至8月社会消费品零售总额同比; 中国8月社会消费品零售总额同比; 中国1至8月规模以上工业增加值同比; 中国8月规模以上工业增加值同比; 22: 00 美国9月密歇根大学消费者信心指数初值						



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!