

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 (2211)	3626.6	-1.4↓	IF次主力合约 (2212)	3618.4	+5.2↑
	IH主力合约 (2211)	2394.8	+5.0↑	IH次主力合约 (2212)	2402.0	+6.4↑
	IC主力合约 (2211)	5863.6	-18.2↓	IC次主力合约 (2212)	5770.0	-13.6↓
	IM主力合约 (2211)	6340.8	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6168.2	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1231.8	-9.6↓	IC-IF当月合约价差	2237.0	-29.2↓
	IM-IC当月合约价差	477.2	+14.4↑	IC-IH当月合约价差	3468.8	-38.8↓
	IM-IF当月合约价差	2714.2	-14.8↓	IM-IH当月合约价差	3946.0	-24.4↓
	IF当季-当月	-8.2	+4.8↑	IF下季-当月	-30.6	+4.2↑
	IH当季-当月	7.2	+6.8↑	IH下季-当月	4.4	+13.2↑
	IC当季-当月	-93.6	-1.2↓	IC下季-当月	-178	+13.8↑
IM当季-当月	-172.6	+7.6↑	IM下季-当月	-307	+18.2↑	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-21,724.00	-2919.0↓	IH前20名净持仓	-26,228	-2113.0↓
	IC前20名净持仓	7,885.00	-3136.0↓	IM前20名净持仓	-2926	-69.0↓
现货价格	沪深300	3627.45	-5.9↓	IF主力合约基差	-0.9	-2.4↓
	上证50	2394.92	+2.3↑	IH主力合约基差	-0.1	-3.0↓
	中证500	5869.78	-27.1↓	IC主力合约基差	-6.2	+0.3↑
	中证1000	6355.78	-22.7↓	IM主力合约基差	-15.0	-18.4↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	8,028.88		两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,532.73	+16.64↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-179.12	+28.45↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+2300
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-409.86	-183.29↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	38.08	+17.68↑	Shibor (日, %)	2.081	+0.687↑
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2211)	79.00	-9.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	22.22	-7.91↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2211)	99.80	-6.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	22.83	-4.12↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	19.57	-0.07↓	成交量PCR (%)	77.33	-4.57↓
				持仓量PCR (%)	56.48	-3.50↓
观点总结	全部A股	4.20	+1.40↑	技术面	3.80	-2.40↓
	资金面	4.50	-1.10↓			
重点关注的消息	1、国家发改委网站信息显示, 国家发改委等部门印发《关于以制造业为重点促进外资扩增量稳存量提质量的若干政策措施》提出, 强化外商投资企业金融支持, 支持符合条件的外商投资企业通过在主板、科创板、创业板、北京证券交易所上市, 在新三板基础层和创新层挂牌, 以及发行公司信用类债券进行融资。支持各类金融机构在依法合规、风险可控前提下创新产品和服务, 按照市场化原则为符合条件的外商投资企业提供优质金融服务和融资支持。鼓励各地依法与各政策性银行、大型银行、股份制银行等金融机构共享制造业外商投资企业和项目信息, 定期举办“银企对接”活动。					
	A股主要指数收跌, 两市成交量有所下行。三大股指盘中探底回升, 沪指一度收复3000点, 深成指、创业板指均走高; 但午后沪指震荡翻绿, 创业板指跌超1%。基本上, 三季度经济主要指标恢复回稳, 明显好于二季度。而随着二十大的闭幕, 政策预期逐步落地, 干扰市场的不确定因素逐渐消除。市场层面看, 当前A股市场面临情绪低点, 相对而言估值水平亦处于较低位置, 因而预计后续大幅度下行概率偏低。海外方面, 在美国CPI涨幅持续走高以及鹰派加息概率逐步上升的情况下, 中美利差倒挂幅度进一步走阔, 并对人民币汇率形成压力, 一定程度上制约了国内货币政策宽松空间。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。					
重点关注的消息	10-25 22: 00 美国10月谘商会消费者信心指数					
	10-26 20: 30 美国9月商品贸易帐(亿美元); 22: 00 美国9月新屋销售(万户); 22: 30 美国10月21日当周EIA原油库存变动(万桶)					
	10-27 20: 15 欧元区欧洲央行存款便利利率; 20: 30 美国三季度个人消费支出(PCE)年化季环比初值; 美国9月耐用品订单环比初值; 美国三季度实际GDP年化季环比初值					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!