

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)	4182.8	-15.8↓	IF次主力合约 (2209)	4156.2	-13.0↓
	IH主力合约 (2208)	2782.0	-18.8↓	IH次主力合约 (2209)	2790.0	-15.8↓
	IC主力合约 (2208)	6429.0	+7.2↑	IC次主力合约 (2209)	6298.0	+11.2↑
	IM主力合约 (2208)	7266.0	+59.6↑	IM次主力合约 (2209)	7058.2	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1400.8	+3.2↑	IC-IF当月合约价差	2246.2	+23.4↑
	IM-IC当月合约价差	837.0		IC-IH当月合约价差	3647.0	+26.6↑
	IM-IF当月合约价差	3083.2		IM-IH当月合约价差	4484.0	
	IF当季-当月	-26.6	+2.8↑	IF下季-当月	-42.2	+6.0↑
	IH当季-当月	8.0	+2.8↑	IH下季-当月	11.6	+0.8↑
	IC当季-当月	-131.0	+1.6↑	IC下季-当月	-222	-2.0↓
IM当季-当月	-207.8		IM下季-当月	-356.2		
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-16,831.00	+2042.0↑	IH前20名净持仓	-18,073	+841.0↑
	IC前20名净持仓	-10,037.00	-2653.0↓	IM前20名净持仓	-1306	+441.0↑
现货价格	沪深300	4185.68	-5.5↓	IF主力合约基差	-2.9	+9.9↑
	上证50	2782.67	-14.2↓	IH主力合约基差	-0.7	+15.3↑
	中证500	6442.81	+22.0↑	IC主力合约基差	-13.8	-24.4↓
	中证1000	7283.50	+54.7↑	IM主力合约基差	-17.5	0.0
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,763.09	-232.28↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,297.47	-60.77↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+38.78	+10.87↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-294.99	-115.57↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)	4000	
	上涨股票比例 (日, %)	47.14	+6.43↑	Shibor (日, %)	1.043	-0.001↓
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2208)	24.60	-10.40↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	14.97	-4.27↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2208)	41.00	+0.40↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	14.92	-5.12↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	15.10	-0.55↓	成交量PCR (%)	71.74	+5.10↑
				持仓量PCR (%)	67.37	-1.43↓
观点总结	全部A股	5.50	+1.30↑	技术面	4.70	+0.70↑
	资金面	6.30	+1.90↑			
观点总结	<p>1、国家统计局: 7月份, 规模以上工业增加值同比实际增长3.8%。从环比看, 7月份, 规模以上工业增加值比上月增长0.38%。1-7月份, 规模以上工业增加值同比增长3.5%。1—7月份, 全国固定资产投资 (不含农户) 319812亿元, 同比增长5.7%。其中, 民间固定资产投资178073亿元, 同比增长2.7%。从环比看, 7月份固定资产投资 (不含农户) 增长0.16%。中国1-7月房地产开发投资79462亿元, 同比下降6.4%; 商品房销售面积78178万平方米, 下降23.1%; 房地产开发企业到位资金88770亿元, 下降25.4%。中国7月社会消费品零售总额35870亿元, 同比增长2.7%, 市场预期增5.3%, 前值增3.1%。其中, 除汽车以外的消费品零售额32046亿元, 增长1.9%。</p> <p>2.8月15日, 央行公告称, 为维护银行体系流动性合理充裕, 8月15日开展4000亿元中期借贷便利 (MLF) 操作 (含对8月16日MLF到期的续做) 和20亿元公开市场逆回购操作, 充分满足了金融机构需求。中期借贷便利 (MLF) 操作和公开市场逆回购操作的中标利率分别为2.75%、2.0%, 均下降10个基点。</p>					
	<p>A股主要指数走势分化。沪指盘中维持窄幅震荡走势; 深成指冲高回落后再度小幅拉升, 创业板指表现较为强势。截至收盘, 沪指微跌0.02%, 深成指涨0.33%, 创业板指涨1.03%。四期指亦形成分化走势, 沪深300以及上证50代表的大盘蓝筹走弱, 中证500以及中证1000代表的中小盘收涨。北向资金小幅净流入10.87亿元。央行超预期降息再度利好赛道股等成长风格, 市场做多情绪有所提振。近期A股行情表现为, 热点轮动较快, 市场缺乏主线, 蓝筹表现相对低迷, 中小市值活跃度较高。当前宏观层面面临的阶段性不确定性和挑战较多有关, 然结合央行二季度货币政策报告以及最新社融数据来看, 宏观流动性仍以宽松为主, 流动性充裕对市场有一定支持。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。</p>					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

重点关注

8-15 22: 50 美联储理事会主办2022年夏季工作坊, 主题为“货币、金融、支付和财务”, 美联储理事沃勒致开幕词
8-16 20: 30 美国7月新屋开工(万户); 美国7月营建许可(万户)
8-17 20: 30 美国7月零售销售环比; 22: 30 美国8月12日当周EIA原油库存变动(万桶)

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!

备注: IF:沪深300 IH:上证50 IC:中证500 IM: 中证1000 IO:沪深300期权

瑞 达 研 究