

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)	3929.0	-15.0↓	IF次主力合约 (2212)	3922.2	-16.0↓
	IH主力合约 (2209)	2681.8	-11.0↓	IH次主力合约 (2212)	2691.6	-12.4↓
	IC主力合约 (2209)	5876.8	-52.8↓	IC次主力合约 (2212)	5810.2	-53.8↓
	IM主力合约 (2209)	6298.2	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	6177.8	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1247.2	-2.6↓	IC-IF当月合约价差	1947.8	-33.0↓
	IM-IC当月合约价差	421.4	-43.8↓	IC-IH当月合约价差	3195.0	-35.6↓
	IM-IF当月合约价差	2369.2	-76.8↓	IM-IH当月合约价差	3616.4	-79.4↓
	IF当季-当月	-6.8	+0.6↑	IF下季-当月	-16.4	-0.8↓
	IH当季-当月	9.8	+0.4↑	IH下季-当月	23.6	-0.8↓
	IC当季-当月	-66.6	-2.4↓	IC下季-当月	-155.6	-1.0↓
IM当季-当月	-120.4	-10.2↓	IM下季-当月	-273.8	-22.0↓	
期货持仓寸 (净多)	IF前20名净持仓	-21,221.00	-354.0↓	IH前20名净持仓	-25,253	+853.0↑
	IC前20名净持仓	1,814.00	-456.0↓	IM前20名净持仓	-705	+32.0↑
现货价格	沪深300	3928.00	-4.7↓	IF主力合约基差	1.0	+4.5↑
	上证50	2679.59	+1.6↑	IH主力合约基差	2.2	+9.4↑
	中证500	5913.15	-41.4↓	IC主力合约基差	-36.4	-36.5↓
	中证1000	6399.80	-81.4↓	IM主力合约基差	-101.6	-98.0↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	6,653.50	-1140.03↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,909.58	-128.01↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-45.12	+16.03↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-20	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-414.89	-193.91↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	23.33	+9.69↑	Shibor (日, %)	1.410	+0.116↑
观点总结	IO平值看涨期权收盘价 (2209)	68.00	-12.60↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	17.85	-6.36↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2209)	92.60	+2.60↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.47	-1.04↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	14.44	-0.06↓	成交量PCR (%)	100.44	-5.39↓
				持仓量PCR (%)	94.65	
重点关注的	全部A股	3.30	+0.90↑	技术面	2.30	+1.00↑
	资金面	4.20	+0.70↑			
行业消息	1、9月16日, 国家统计局: 8月社会消费品零售总额同比增长5.4%, 比上月加快2.7个百分点, 规模以上工业增加值同比增长4.2%, 比上月加快0.4个百分点。1~8月固定资产投资同比增长5.8%, 较前7个月加快0.1个百分点。				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数收跌。三大股指早盘探底回升, 午后弱势震荡下探。沪指盘中下行近3100点关口。截至收盘, 沪指跌0.35%, 深成指跌0.48%, 创业板指跌0.72%。四期指仅上证50尾盘翻红, 中证1000收跌超过1%。外围多方利空情绪影响或是近期市场下跌的主要原因。短线上, 预计本周市场将延续震荡偏弱格局。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。基本上, 上周主要经济数据出炉, 多宏观指标相较上月有所改善。央行开展4000亿MLF操作, 预计9月起资金面将逐步从宽松走向收敛, 资金利率延续低位, 中枢或小幅抬升, 后续通过降准置换MLF和继续调降LPR仍有空间。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。				<p>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	9-20 09: 15 中国9月五年期贷款市场报价利率(LPR); 中国9月一年期贷款市场报价利率(LPR); 20: 30 美国8月营建许可(万户) 9-21 22: 00 美国8月成屋销售总数年化(万户); 22: 30 美国9月16日当周EIA原油库存变动(万桶) 9-22 02: 00 美联储FOMC公布利率决议、政策声明及经济预期; 美国FOMC利率决策(上限); 美国FOMC利率决策(下限); 20: 30 美国9月17日当周首次申请失业救济人数(万人)					