

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)	3726.8	-2.4↓	IF次主力合约 (2212)	3732.4	-0.8↓
	IH主力合约 (2210)	2538.4	-12.0↓	IH次主力合约 (2212)	2546.0	-13.6↓
	IC主力合约 (2210)	5682.8	+39.6↑	IC次主力合约 (2212)	5646.2	+40.8↑
	IM主力合约 (2210)	5994.2	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	5900.6	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1188.4	+5.6↑	IC-IF当月合约价差	1956.0	+44.4↑
	IM-IC当月合约价差	311.4	-24.8↓	IC-IH当月合约价差	3144.4	+50.0↑
	IM-IF当月合约价差	2267.4	+19.6↑	IM-IH当月合约价差	3455.8	+25.2↑
	IF当季-当月	5.6	+5.2↑	IF下季-当月	6.2	+7.6↑
	IH当季-当月	7.6	+1.0↑	IH下季-当月	19.6	-1.0↓
	IC当季-当月	-36.6	+3.2↑	IC下季-当月	-106	+2.8↑
IM当季-当月	-93.6	-2.6↓	IM下季-当月	-216.4	-4.2↓	
期货持仓寸 (净多)	IF前20名净持仓	-20,860.00	-2214.0↓	IH前20名净持仓	-28,828	-3841.0↓
	IC前20名净持仓	5,481.00	-551.0↓	IM前20名净持仓	-487	+102.0↑
现货价格	沪深300	3727.69	+6.8↑	IF主力合约基差	-0.9	+7.3↑
	上证50	2539.95	-5.1↓	IH主力合约基差	-1.6	+0.3↑
	中证500	5684.51	+48.8↑	IC主力合约基差	-1.7	+4.1↑
	中证1000	6017.72	+33.2↑	IM主力合约基差	-23.5	-8.5↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	5,638.16	-641.74↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,366.63	-15.73↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+14.31	-12.44↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-620	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-285.27	-40.11↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	60.95	+44.01↑	Shibor (日, %)	1.183	+0.073↑
行业消息	IO平值看涨期权收盘价 (2210)	41.40	-2.20↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	18.76	-5.05↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2210)	61.20	-8.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.61	-1.99↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.22	+0.12↑	成交量PCR (%)	88.71	+3.72↑
				持仓量PCR (%)	50.70	-2.38↓
观点总结	全部A股	6.30	+3.70↑	技术面	6.10	+4.40↑
	资金面	6.50	+2.50↑			
重点关注的	1、乘联会: 9月乘用车市场零售达到192.2万辆, 同比增长21.5%, 增长较快; 9月零售环比增长2.8%, 环比增速处于近20年同期历史低位。1-9月累计零售1487.5万辆, 同比增长2.4%, 同比净增35.5万辆, 其中6-9月同比净增143万辆, 增量贡献巨大。					
	A股主要指数缩量上涨。沪指早盘探底回升, 午后维持窄幅震荡走势; 深成指小幅走高, 创业板指表现相对强势, 涨超1%。四期指走势分化, 中证500以及中证1000表现较强, 上证50小幅收跌。北向资金小幅净流出。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, 预计后续指数下行的空间不大。海外经济增长动能回落同时货币紧缩预期增强, 外围市场风险偏好回落趋势尚在, 海内外不确定性因素或仍对A股独立性走势形成干扰。国内层宽货币向宽信用的传导效应还存在较多不确定性, 因而后续内需的修复仍有较大的预期波动。综合来看, 后续市场风格预计偏均衡, 建议投资者观望为主, 关注景气修复和政策导向型机会。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。					
	10-12 20: 30 美国9月PPI同比; 美国9月核心PPI环比; 美国9月PPI环比; 美国9月核心PPI同比 10-13 20: 30 美国10月8日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国9月核心CPI同比; 美国9月CPI同比; 美国9月核心CPI环比; 美国9月CPI环比; 23: 00 美国10月7日当周EIA原油库存变动(万桶) 10-14 09: 30 中国9月CPI同比; 中国9月PPI同比; 22: 00 美国10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!