

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 (2207)	4306.6	+2.2↑	IF次主力合约 (2209)	4276.8	+2.4↑
	IH主力合约 (2207)	2898.4	-10.0↓	IH次主力合约 (2209)	2892.0	-9.6↓
	IC主力合约 (2207)	6240.2	+6.8↑	IC次主力合约 (2209)	6163.6	+10.6↑
	IF-IH当月合约价差	1408.2	+16.6↑	IC-IF当月合约价差	1933.6	+8.8↑
				IC-IH当月合约价差	3341.8	+25.4↑
	IF当季-当月	-29.8	-0.4↓	IF下季-当月	-57.6	-1.2↓
	IH当季-当月	-6.4	+1.4↑	IH下季-当月	-1.4	+1.8↑
	IC当季-当月	-76.6	+2.0↑	IC下季-当月	-173.6	-1.4↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-18,206.00	+108.0↑	IH前20名净持仓	-19,814	+191.0↑
	IC前20名净持仓	-11,856.00	-1334.0↓			
现货价格	沪深300	4321.46	+7.8↑	IF主力合约基差	-14.9	-20.7↓
	上证50	2914.29	-7.7↓	IH主力合约基差	-15.9	-5.1↓
	中证500	6268.49	+27.0↑	IC主力合约基差	-28.3	-42.9↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,423.10	-344.16↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,164.07	-36.77↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-42.51	-68.74↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-30	+30
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-385.45	-137.87↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	70.28	+49.34↑	Shibor (日, %)	1.219	+0.008↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	33.00	-4.20↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	18.26	-8.03↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	24.00	-14.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.00	-8.36↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.04	-0.58↓	成交量PCR (%)	87.11	-1.92↓
			持仓量PCR (%)	84.28	-1.44↓	
Wind市场强弱分析	全部A股	6.90	+3.90↑	技术面	7.00	+4.90↑
	资金面	6.70	+2.80↑			
行业消息	1、海关总署: 中国6月出口 (以美元计) 同比增加17.9%, 预期增11.9%, 前值增16.9%; 进口增1.0%, 预期增3.0%, 前值增4.1%; 贸易顺差979.4亿美元, 预期764.7亿美元, 前值787.6亿美元。6月全国进出口总值数据显示, 中国6月出口 (以人民币计) 同比增22%, 前值增15.3%; 进口增4.8%, 前值增2.8%; 贸易顺差6501.1亿元, 前值5028.9亿元。				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数集体反弹, 沪指午后回落震荡, 尾盘收涨0.09%, 深指收涨0.56%, 创业板指午后反攻领涨, 收涨1.63%。三期指涨跌不一, 其中上证50收跌0.26%, 沪深300以及中证500均小幅收涨。沪深两市小幅缩量。赛道股表现活跃, 风电、光伏领涨。日线上结束连阴走势, 呈现企稳态势, 但前期反弹回踩动能尚未完全释放, 预计A股整体震荡整理的基调还将持续, 建议投资者配置方面选择逢低位布局。本次A股独立行情受政策因素影响较大, 需持续关注政策预期对投资者情绪的影响。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, 在稳增长政策发力下, 建议轻仓介入多IC合约。				<p>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	7-13 20: 30 美国6月核心CPI同比; 美国6月CPI同比; 美国6月核心CPI环比; 美国6月CPI环比 7-14 20: 30 美国7月9日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国6月核心PPI同比; 美国6月PPI同比; 美国6月核心PPI环比; 美国6月PPI环比 7-15 10: 00 中国1至6月全国房地产开发投资; 中国1至6月城镇固定资产投资同比; 中国1至6月社会消费品零售总额同比; 中国6月社会消费品零售总额同比; 中国一至二季度GDP同比; 中国1至6月规模以上工业增加值同比; 中国二季度GDP同比; 中国6月规模以上工业增加值同比; 22: 00 美国7月密歇根大学消费者信心指数初值					