瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

股指期货全景日报

2022/9/29

撰写人：张昕　从业资格证号：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）	3837.6	-4.8↓	IF次主力合约（2212）	3839.4	+1.2↑
	IH主力合约（2210）	2611.8	-4.8↓	IH次主力合约（2212）	2618.8	-5.2↓
	IC主力合约（2210）	5790.8	+0.4↑	IC次主力合约（2212）	5751.0	+10.0↑
	IM主力合约（2210）	6232.4	+59.6↑	IM次主力合约（2212）	6149.2	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1225.8	+2.6↑	IC-IF当月合约价差	1953.2	+17.8↑
	IM-IC当月合约价差	441.6	+11.0↑	IC-IH当月合约价差	3179.0	+20.4↑
	IM-IF当月合约价差	2394.8	+28.8↑	IM-IH当月合约价差	3620.6	+31.4↑
	IF当季-当月	1.8	+5.4↑	IF下季-当月	-4.6	+6.4↑
	IH当季-当月	7.0	-1.2↓	IH下季-当月	19.2	-1.4↓
	IC当季-当月	-39.8	+11.0↑	IC下季-当月	-122	+5.8↑
	IM当季-当月	-83.2	-2.6↓	IM下季-当月	-194.8	-6.4↓
期货持仓头寸（净多）	IF前20名净持仓	-21,279.00	-1421.0↓	IH前20名净持仓	-26,984	-2518.0↓
	IC前20名净持仓	5,645.00	-1430.0↓	IM前20名净持仓	-2141	-1552.0↓
现货价格	沪深300	3827.14	-1.6↓	IF主力合约基差	10.5	+7.9↑
	上证50	2608.98	-3.0↓	IH主力合约基差	2.8	+1.4↑
	中证500	5771.88	+2.4↑	IC主力合约基差	18.9	+2.5↑
	中证1000	6228.78	+17.7↑	IM主力合约基差	3.6	-8.5↓
	A股成交额（日，亿元）	6,245.73	-3952.18↓	两融余额（前一交易日，亿元）	15,631.14	-97.23↓
	陆股通（昨日，今日，亿元）	-38.40	+34.29	逆回购（到期量，操作量，亿元）	-20	+1820
	主力资金（昨日，今日，亿元）	-391.26	-391.26	MLF（续作量，净投放，亿元）		
	上涨股票比例（日，%）	33.17	-79.99↓	Shibor（日，%）	0.964	-0.129↓
	IO平值看涨期权收盘价（2210）	63.00	-0.40↓	IO平值看涨期权隐含波动率（%）	21.18	+3.96↑
	IO平值看跌期权收盘价（2210）	73.20	2-3.6	IO平值看跌期权隐含波动率（%）	20.41	+1.07↑
	沪深300指数20日波动率（%）	14.70	-0.03↓	成交量PCR（%）	84.28	-8.91↓
				持仓量PCR（%）	65.70	-4.31↓
Wind市场强弱分析	全部A股	4.00	+1.80↑	技术面	3.30	+2.40↑
	资金面	4.70	+1.20↑			

行业消息

1、9月27日，全国外汇市场自律机制电视会议召开。会议强调，外汇市场事关重大，保持稳定是第一要义。当前外汇市场运行总体上是规范有序的，但也存在少数企业跟风“炒汇”、金融机构违规操作等现象，应当加强引导和纠偏。必须认识到，汇率的点位是测不准的，双向浮动是常态，不要赌人民币汇率单边升值或贬值，久赌必输。会议要求，自律机制成员单位要自觉维护外汇市场的基本稳定，坚决抑制汇率大起大落。报价行要切实维护人民币汇率中间价的权威性。

更多观点请咨询！

观点总结

A股主要指数缩量下跌。两市股指高开高走，盘中发力拉升，沪指一度涨约1%，创业板指涨近2%；但随后沪指在地产、酿酒、金融等板块影响下震荡下探，午后翻绿，深成指、创业板指涨幅收窄。四期指涨跌不一，沪深300以及上证50小幅收跌，中证500以及中证1000小幅收涨。美元走强、全球范围央行加息抗通胀导致经济衰退恐慌预期下，外围市场持续偏负面影响，全球市场风险偏好受到打击。静待十月份二十大政策定调，提振市场整体做多情绪，引领增量资金入市。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。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。

更多资讯请关注！

重点关注

9-29 20：30 美国二季度个人消费支出(PCE)年化季环比终值；美国二季度实际GDP年化季环比终值 ；美国9月24日当周首次申请失业救济人数(万人)

9-30 09：30 中国9月官方非制造业PMI；中国9月官方制造业PMI；中国9月官方综合PMI；中国9月财新制造业PMI；20：30 美国8月个人消费支出(PCE)环比；美国8月个人收入环比；22：00 美国9月密歇根大学消费者信心指数终值

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