

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)	3728.2	-86.2↓	IF次主力合约 (2212)	3728.6	-86.4↓
	IH主力合约 (2210)	2545.4	-69.0↓	IH次主力合约 (2212)	2552.0	-68.0↓
	IC主力合约 (2210)	5639.8	-86.8↓	IC次主力合约 (2212)	5600.0	-85.4↓
	IM主力合约 (2210)	5976.0	+59.6↑	IM次主力合约 (2212)	5885.0	+66.0↑
	IF-IH当月合约价差	1182.8	-15.6↓	IC-IF当月合约价差	1911.6	+9.8↑
	IM-IC当月合约价差	336.2	-56.6↓	IC-IH当月合约价差	3094.4	-5.8↓
	IM-IF当月合约价差	2247.8	-46.8↓	IM-IH当月合约价差	3430.6	-62.4↓
	IF当季-当月	0.4	+0.2↑	IF下季-当月	-1.4	+3.0↑
	IH当季-当月	6.6	+1.6↑	IH下季-当月	20.6	+0.2↑
	IC当季-当月	-39.8	-0.6↓	IC下季-当月	-108.8	+5.4↑
	IM当季-当月	-91.0	-9.0↓	IM下季-当月	-212.2	-2.2↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-18,646.00	+2831.0↑	IH前20名净持仓	-24,987	+623.0↑
	IC前20名净持仓	5,187.00	+845.0↑	IM前20名净持仓	-589	-443.0↓
现货价格	沪深300	3720.94	-84.0↓	IF主力合约基差	7.3	+3.5↑
	上证50	2545.05	-65.1↓	IH主力合约基差	0.3	-0.1↓
	中证500	5635.71	-78.4↓	IC主力合约基差	4.1	-3.9↓
	中证1000	5984.50	-140.4↓	IM主力合约基差	-8.5	-21.9↓
	A股成交额 (日, 亿元)	6,279.90	+671.49↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,382.36	-409.56↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-13.01	+14.31↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-930	+20
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-201.30	-285.27↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	16.94	-8.95↓	Shibor (日, %)	1.110	-0.068↓
	IO平值看涨期权收盘价 (2210)	68.60	-71.60↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	20.07	-14.40↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2210)	46.00	+18.60↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.65	-13.50↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.10	+1.51↑	成交量PCR (%)	84.99	-3.90↓
				持仓量PCR (%)	53.08	-9.56↓
Wind市场强弱分析	全部A股	2.60	-0.70↓	技术面	1.70	-0.80↓
	资金面	3.60	+0.40↑			
行业消息	1、中国人民银行决定,自2022年10月1日起,下调首套个人住房公积金贷款利率0.15个百分点,5年以下(含5年)和5年以上利率分别调整为2.6%和3.1%。第二套个人住房公积金贷款利率政策保持不变,即5年以下(含5年)和5年以上利率分别不低于3.025%和3.575%。					
观点总结	A股主要指数节后收跌。两市股指盘中大幅下探,沪指跌超1.5%失守3000点整数关口,深成指、创业板指跌超2%。四期指均大幅收跌,沪深300、上证50以及中证1000跌幅超过2%。北向资金小幅净流入。从美国新出炉的宏观指标来看,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将拓宽A股波动区间。国内层面,当前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。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。				更多观点请咨询!  更多资讯请关注!	
重点关注	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					

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