

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 (2201)	4845.6	+9.60↑	IF次主力合约 (2203)	4841.2	+10.80↑
	IH主力合约 (2201)	3238.4	+7.00↑	IH次主力合约 (2203)	3252.0	+11.60↑
	IC主力合约 (2201)	7191.0	-7.00↓	IC次主力合约 (2203)	7129.2	-11.00↓
	IF-IH当月合约价差	1607.2	+4.40↑	IC-IF当月合约价差	2345.4	-17.00↓
				IC-IH当月合约价差	3952.6	-12.60↓
	IF当季-当月	-4.4	+2.4↑	IF下季-当月	-33.2	-1.2↓
	IH当季-当月	13.6	+5.8↑	IH下季-当月	2.8	+5.4↑
IC当季-当月	-61.8	-8.4↓	IC下季-当月	-201.6	-6.0↓	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-31061	-1695↓	IH前20名净持仓	-22759	-1318↓
	IC前20名净持仓	-29252	-3516↓			
现货价格	沪深300	4844.05	+21.68↑	IF主力合约基差	1.55	+16.0↑
	上证50	3236.12	+12.85↑	IH主力合约基差	2.28	+11.6↑
	中证500	7191.45	+15.78↑	IC主力合约基差	-0.45	-1.0↓
资金面	A股成交额 (日, 亿元)	10,513.83	-1558.15↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	18,145.99	-175.92↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+93.35	+47.58↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	0	100
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-429.92	-198.72↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	66.18	+45.17↑	Shibor (日, %)	1.878	+0.04↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2201)	52.20	+4.80↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	14.04	-1.68↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2201)	56.40	-12.00↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	14.76	+0.52↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	13.09	+0.21↑	成交量PCR (%)	80.83	+1.60↑
				持仓量PCR (%)	60.97	-3.90↓
Wind市场强弱分析	全部A股	6.60	+3.50↑	技术面	6.60	+4.50↑
	资金面	6.60	+2.50↑			
行业消息	1.1月7日消息, 根据《财政部、发展改革委关于证券期货业、银行业和保险业监管费有关问题的通知》(下称《通知》), 自2021年1月1日起, 银保监会恢复征收银行业监管费、保险业监管费, 证监会恢复征收证券期货业机构监管费; 对北京证券交易所自开市之日起收取证券业务监管费。					
观点总结	A股主要指数走势分化, 指数早盘低开下行, 午后回升。三大指数中, 创业板指小幅收跌, 沪指以及深证成指收涨。三期指数中, 沪深300以及上证50较为强势。市场成交量维持在万亿元上方, 北向资金呈现净流入。上周以来, 股指持续回调, 去年估值偏高的热门赛道受到资金撤出压力连续下挫, 市场整体风险偏好受到打击。在宏观预期偏弱, 市场缺乏利好消息的情况下, 当前市场呈现出价值优于成长的行情趋势。总体而言, 当前海外流动性紧缩担忧不减反增, 外盘风险偏好受到一定程度的打击。一季度市场震荡风险加剧, 市场风险偏好显著回升静待流动性预期以及经济维稳政策落地。技术面上, 上证指数阻力位前下行, 3600点左右震荡加剧, 中证500上行走势收到抑制, 短线存在整理回调倾向。而沪深300与上证50回落至近半年的震荡平台内。策略上, 建议观望为主, 短线轻仓介入IH2112多单, 持续关注多IC机会。					 更多资讯请关注!
重点关注	1-11 待定 中国12月M2货币供应同比; 中国12月M1货币供应同比; 中国12月M0货币供应同比; 中国12月新增人民币贷款(亿人民币); 中国12月社会融资规模增量(亿人民币) 12 9: 30 中国12月CPI同比; 中国12月PPI同比; 21: 30 美国12月核心CPI同比; 美国12月CPI同比; 美国12月核心CPI环比; 美国12月CPI环比					1-

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 IO:沪深300期权