

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)	4300.8	-35.0↓	IF次主力合约 (2209)	4271.4	-33.2↓
	IH主力合约 (2207)	2909.2	-15.2↓	IH次主力合约 (2209)	2901.4	-15.6↓
	IC主力合约 (2207)	6225.6	-69.0↓	IC次主力合约 (2209)	6147.0	-71.6↓
	IF-IH当月合约价差	1391.6	-19.0↓	IC-IF当月合约价差	1924.8	-42.0↓
				IC-IH当月合约价差	3316.4	-61.0↓
	IF当季-当月	-29.4	+1.0↑	IF下季-当月	-56.4	-1.8↓
	IH当季-当月	-7.8	-1.4↓	IH下季-当月	-3.2	-0.6↓
	IC当季-当月	-78.6	-1.2↓	IC下季-当月	-172.2	+3.0↑
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-18,314.00	-1442.0↓	IH前20名净持仓	-20,005	+1526.0↑
	IC前20名净持仓	-10,522.00	-193.0↓			
现货价格	沪深300	4313.62	-41.0↓	IF主力合约基差	-12.8	+23.4↑
	上证50	2922.00	-20.3↓	IH主力合约基差	-12.8	+4.4↑
	中证500	6241.48	-77.7↓	IC主力合约基差	-15.9	+62.3↑
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,767.26	-320.09↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,200.84	-5.49↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-10.68	-42.51↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-30	+30
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-558.63	-385.45↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	20.94	-8.75↓	Shibor (日, %)	1.211	-0.012↓
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	37.20	-29.60↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.98	-2.49↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	38.20	+9.20↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.51	-4.98↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.62	+0.32↑	成交量PCR (%)	89.03	-17.45↓
			持仓量PCR (%)	85.72	-6.05↓	
Wind市场强弱分析	全部A股	3.00	-0.40↓	技术面	2.10	-0.90↓
	资金面	3.90	+0.10↑			
行业消息	1、央行: 上半年新增人民币贷款13.68万亿元, 同比多增9192亿元; 其中, 6月新增人民币贷款2.81万亿元, 同比多增6867亿元。上半年社会融资规模增量为21万亿元, 比上年同期多3.2万亿元; 其中, 6月社融增量5.17万亿元, 比上年同期多1.47万亿元。6月末M2同比增长11.4%, 创下今年以来同比增速新高, 连续3个月保持两位数增速。				 <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数延续回调趋势。沪深全天低开低走, 尾盘收跌接近1%。创业板指震荡下行, 午后跌幅扩大超过2%。三期指均收跌, 中证500走势较弱, 回调超过1%。沪深两市呈现缩量下跌的局势, 北向资金净流出扩大。近期半年报业绩预告期下, 市场预期波动被放大, 叠加指数短线反弹接近年线位置, 短线上预计存在反复趋势, A股进入震荡整理期。关注企业半年报业绩披露以及本周最新宏观数据, 核心经济指标的修复程度将是后期短线市场情绪的支撑, 后续行情波动亦或放大, 建议投资者逢低布局。整体上看, 当前A股依然呈现相对强势走势, 结合估值水平尚未达到合理水平以上, 中长期市场仍具有一定的上行空间。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 待定 中国6月贸易帐(按人民币计)(亿人民币); 中国6月进口同比(按人民币计); 中国6月出口同比(按人民币计); 中国6月进口同比(按美元计); 中国6月出口同比(按美元计); 中国6月贸易帐(按美元计)(亿美元); 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					