

股指期货日报

2021年10月22日星期五

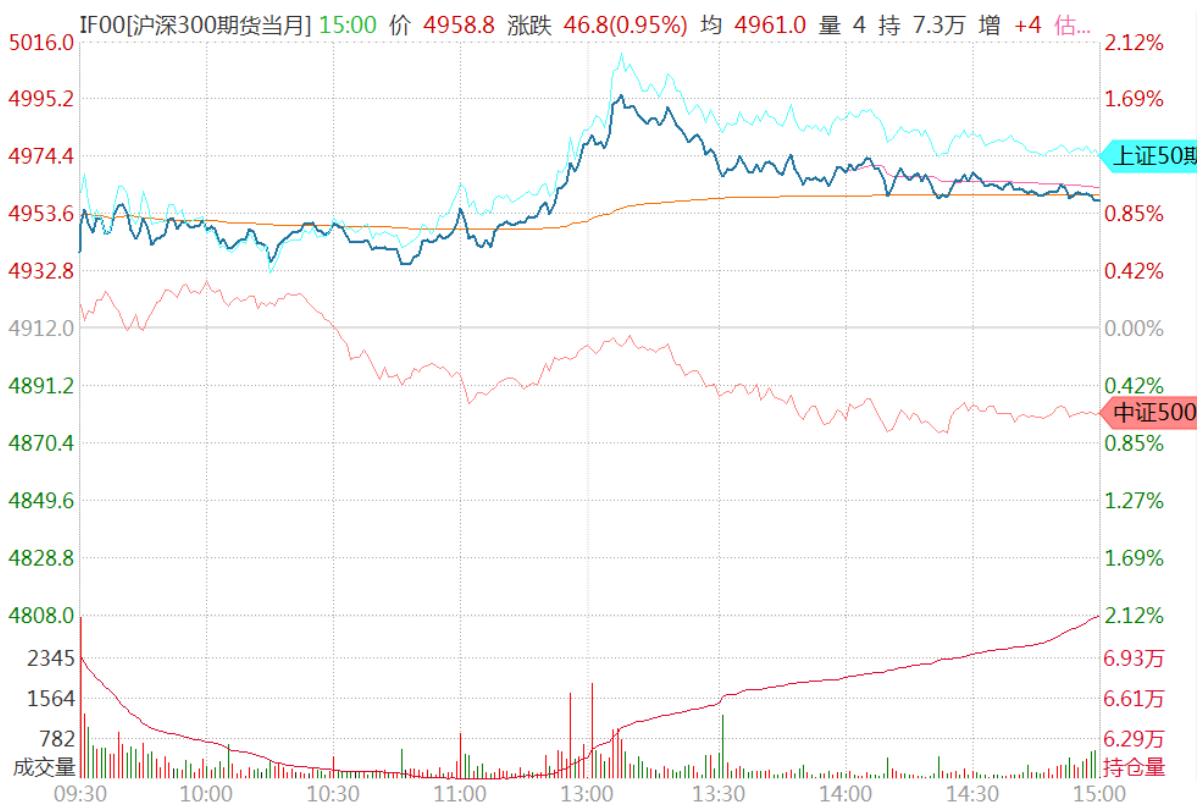


南华期货研究所 张思仪

0571-81727107 zhangsiyi@nawaa.com 投资咨询证号: Z0013854

北向资金大额净流入

1. 图解行情



来源: WIND 南华研究

每日观察:

今天 A 股三大股指小幅反弹后回落,收盘沪指跌 0.34%,深证成指涨 0.33%,创业板指涨 0.17%, 家电、消费板块领涨,煤炭、钢铁等周期板块领跌。万得全 A 指数成份中涨停家数 49 家,跌停 17

家，涨跌家数比 0.46，市场情绪弱，赚钱效应差。两市成交金额过万亿元。北向资金大额净买入 131.82 亿元，刷新 6 月 25 日以来新高，连续两日净买入超百亿，为年内首次，本周北向资金累计净买入 233 亿元。期指方面，IF 主力涨 0.95%，IH 涨 1.28%，IC 跌 0.61%，IC 贴水收窄，成交量变化不大。

双十一购物节启动，两大头部主播双 11 首日预售销售额创下近 200 亿遭热议，带动家电消费板块上涨。由于人民币汇率持续升值，中美关系出现缓和，本周北向资金出现大额净流入。这两个原因短期内可能会延续，下周北向资金可能仍有较大幅度净流入。但从市场情绪上看，今天的市场情绪仍然较低。

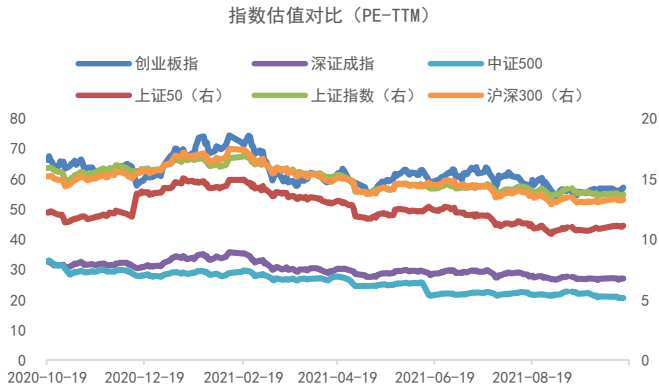
行情概览

2.1 股指期货日内基本行情

品种	合约	收盘价	涨跌幅	成交量	成交量变动	持仓量	持仓变动	交割日	剩余天数	最新基差	前一日基差
IF	IF00.CFE	4958.8	0.95276873	71500	1642	72549	1816	2021-11-19	28	-0.9254	-0.4156
	IF01.CFE	4953.4	1.073294156	25417	3154	80255	-534	2021-12-17	56	-6.3254	-11.6156
	IF02.CFE	4926.2	1.116630404	6465	1480	31983	570	2022-03-18	147	-33.5254	-40.0156
	IF03.CFE	4890	1.158460902	1278	288	2316	43	2022-06-17	238	-69.7254	-83.8156
IH	IH00.CFE	3318.2	1.275790502	43358	327	45990	1212	2021-11-19	28	0.0725	6.4581
	IH01.CFE	3317.4	1.214303149	17150	871	42700	-427	2021-12-17	56	-0.7275	3.6581
	IH02.CFE	3308.8	1.447142507	4502	407	13098	168	2022-03-18	147	-9.3275	-9.5419
	IH03.CFE	3295.4	1.478105561	1040	235	1542	215	2022-06-17	238	-22.7275	-25.7419
IC	IC00.CFE	7004.2	-0.612992025	47215	4690	77968	4010	2021-11-19	28	-21.8676	-44.2542
	IC01.CFE	6953.8	-0.509342719	20522	1308	102767	-906	2021-12-17	56	-72.2676	-102.8542
	IC02.CFE	6791	-0.378476705	8662	-450	74768	-369	2022-03-18	147	-235.0676	-273.4542
	IC03.CFE	6634.4	-0.306545651	3364	-319	8181	859	2022-06-17	238	-391.6676	-432.4542

数据来源：Wind，南华研究

图 2.1 估值情况



资料来源：Wind 资讯 南华研究

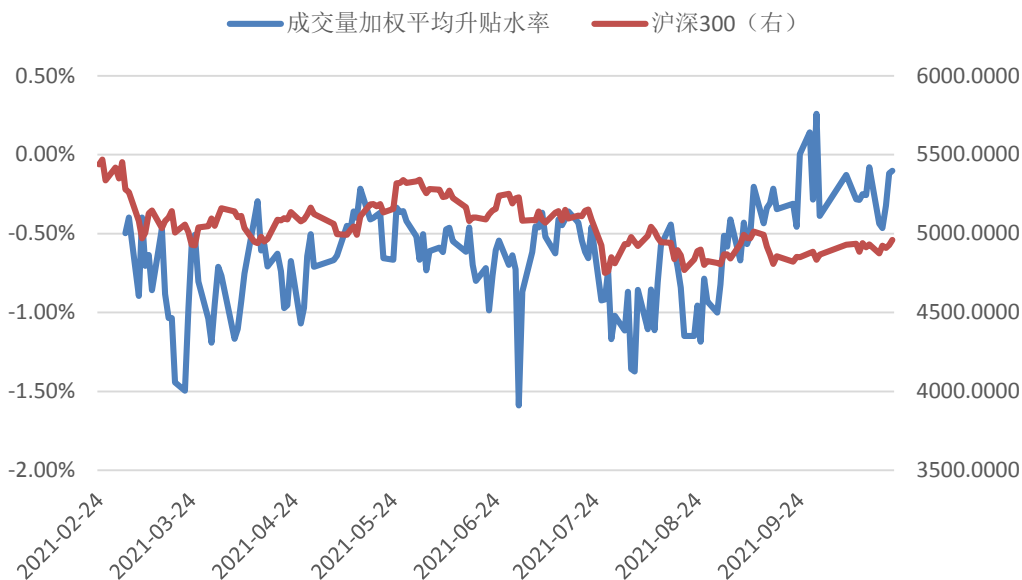
图 2.2 融资融券



资料来源：Wind 资讯 南华研究

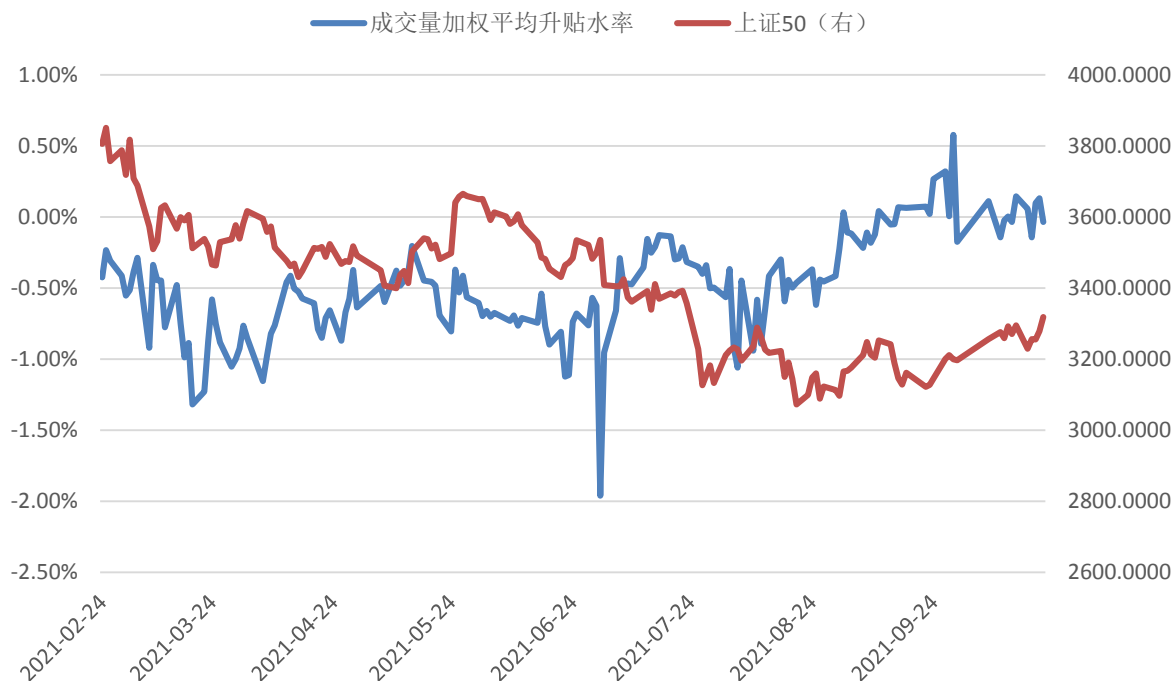
3.期指升贴水变化

3.1 沪深 300 指数期货



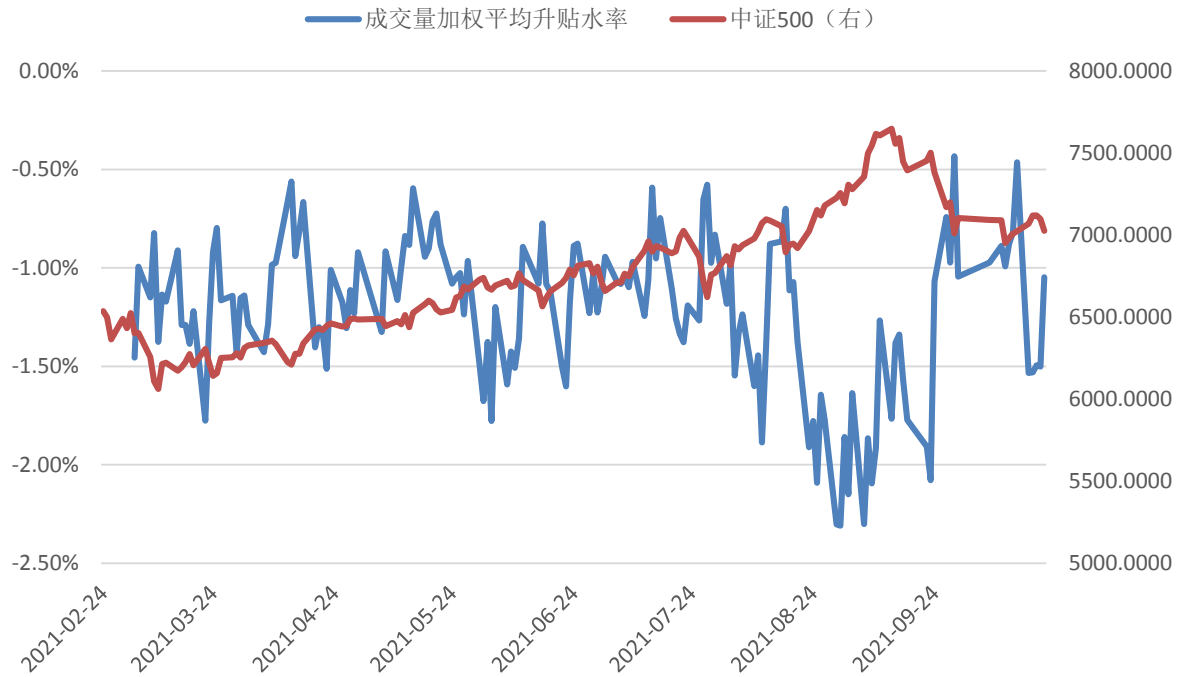
数据来源：Wind，南华研究

3.2 上证 50 指数期货



数据来源：Wind，南华研究

3.3 中证500 指数期货



数据来源：Wind，南华研究

注：升贴水率=（期货合约价格-现货价格）/现货价格

成交量加权平均升贴水率为该品种当月、次月、当季和下季期货合约的升贴水率按照成交量加权平均的结果。

升贴水率一定程度上体现了市场对未来行情预期，暗示市场情绪情况，升贴水率走低一般代表市场情绪转弱，反之则代表市场情绪回暖。

免责声明

本报告中的信息均来源于已公开的资料，尽管我们相信报告中资料来源的可靠性，但我们对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。也不保证我公司所做出的意见和建议不会发生任何的变更，在任何情况下，我公司报告中的信息和所表达的意见和建议以及所载的数据、工具及材料均不能作为您所进行期货买卖的绝对依据。由于报告在编写时融入了该分析师个人的观点和见解以及分析方法，如与南华期货股份有限公司发布的其他信息有不一致及有不同的结论，未免发生疑问，本报告所载的观点并不代表了南华期货股份有限公司的立场，所以请谨慎参考。我公司不承担因根据本报告所进行期货买卖操作而导致的任何形式的损失。

另外，本报告所载资料、意见及推测只是反映南华期货股份有限公司在本报告所载明的日期的判断，可随时修改，毋需提前通知。未经南华期货股份有限公司允许批准，本报告内容不得以任何范式传送、复印或派发此报告的材料、内容或复印本予以任何其他人，或投入商业使用。如遵循原文本意的引用、刊发，需注明出处“南华期货股份有限公司”，并保留我公司的一切权利。



公司总部地址：杭州西湖大道 193 号定安名都 3 层 邮编：310002

全国统一客服热线：4008888910

网址：www.nanhua.net

股票简称：南华期货 股票代码：603093

南华期货营业网点