

股指期货日报

2021 年 10 月 19 日星期二



南华期货研究所 张思仪

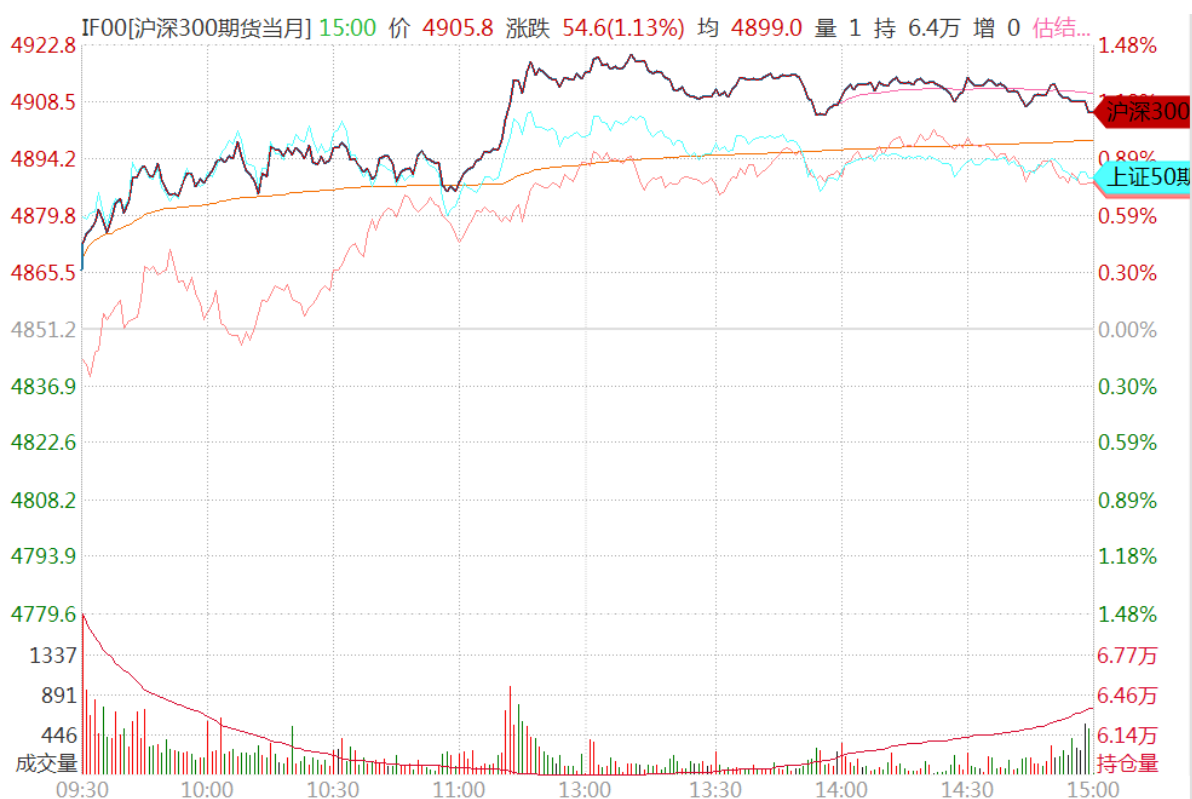
0571-81727107

zhangsiyi@nawaa.com

投资咨询证号: Z0013854

期指集体收涨

1. 图解行情



来源: WIND 南华研究

每日观察:

今天 A 股三大股指集体收涨, 收盘沪指涨 0.70%, 深证成指涨 1.04%, 创业板指涨 0.64%, 养鸡养猪板块领涨。万得全 A 指数成份中涨停家数 85 家, 跌停家数降至 9 家, 市场情绪转暖, 涨

跌家数比约为 1，赚钱效应好。两市成交金额近万亿元。北向资金净买入 39.06 亿元。期指方面，IF 主力涨 1.13%，IH 涨 0.79%，IC 涨 0.76%，期指成交量大幅缩小。

近日华为签约全球最大储能项目，受消息影响，今天储能板块上涨。第十五届指数与指数化投资论坛在上海浦东举行。深圳证券交易所副总经理李辉表示，积极推动深市指数衍生品上市，为国际投资者提供更丰富精准的风险管理工具，促进国内指数化投资取得更大发展。深市指数衍生品上市将丰富市场上的指数产品，吸引更多投资者参与指数期货，中长期利好期指。央行主管媒体刊载马骏文章：碳中和愿景下的绿色金融路线图。文章提到建立绿色债券评估机制，推出更多融入 ESG 要素的投资产品，建议尽快推出碳期货产品，发挥风险管理功能，建立规范的碳金融市场，适时允许金融机构参与全国碳市场，拓宽控排企业节能降碳资金来源；可以考虑将较低风险的绿色资产纳入商业银行向央行借款的合格抵押品范围等等。上海市地方金融监督管理局召开新闻通气会，介绍《上海加快打造国际绿色金融枢纽 服务碳达峰碳中和目标的实施意见》。绿色金融的进一步推行，有利于提高上市公司质量，有利于资本市场长期健康发展，中长期利好期指。

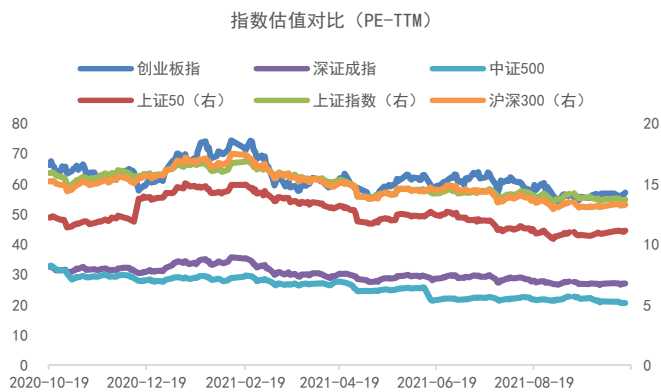
行情概览

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	4905.8	1.125494723	55594	-16138	63516	-8356	2021-11-19	31	-16.9232	-14.7753
	IF01.CFE	4895.6	1.190574618	17602	-5382	79140	-2190	2021-12-17	59	-27.1232	-26.9753
	IF02.CFE	4867.2	1.180774988	5448	-1947	29778	-660	2022-03-18	150	-55.5232	-54.7753
	IF03.CFE	4836	1.108091156	1296	-155	1962	523	2022-06-17	241	-86.7232	-84.7753
IH	IH00.CFE	3253.6	0.786816182	34572	-11698	39907	-5709	2021-11-19	31	-3.068	3.5687
	IH01.CFE	3252.6	0.818300167	13684	-4875	43477	-575	2021-12-17	59	-4.068	2.3687
	IH02.CFE	3238.8	0.771624144	3179	-2148	12453	-690	2022-03-18	150	-17.868	-10.0313
	IH03.CFE	3226.8	0.799700112	768	-185	1065	130	2022-06-17	241	-29.868	-23.4313
IC	IC00.CFE	7070	0.761052362	41351	-10394	72486	-4328	2021-11-19	31	-50.3794	-47.1048
	IC01.CFE	7013.6	0.82226439	18267	-3951	106587	-3366	2021-12-17	59	-106.7794	-107.3048
	IC02.CFE	6843.6	0.825033885	8472	-3205	75338	-1041	2022-03-18	150	-276.7794	-276.5048
	IC03.CFE	6686	0.865944543	3201	-551	4147	445	2022-06-17	241	-434.3794	-436.1048

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

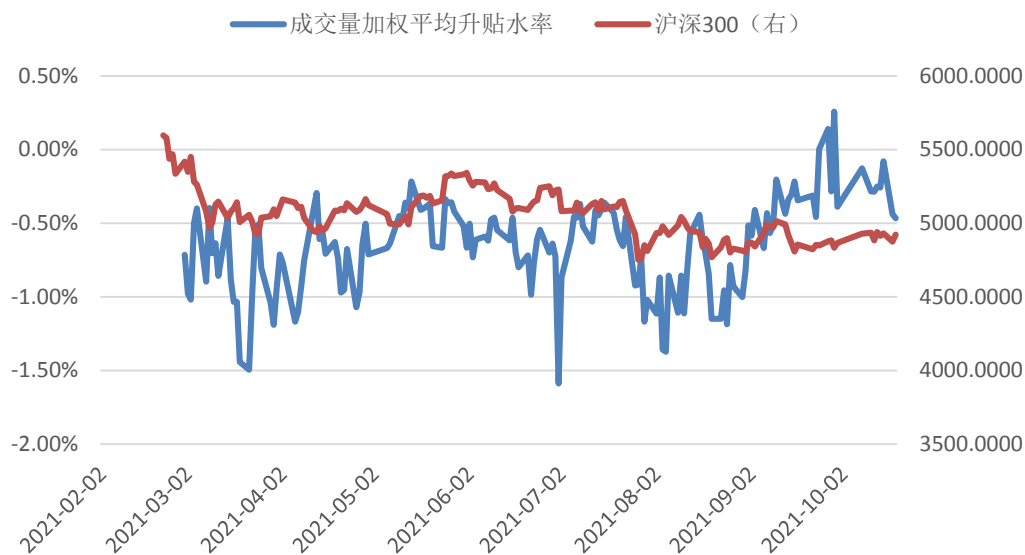
图 2.2 融资融券



资料来源：Wind 资讯 南华研究

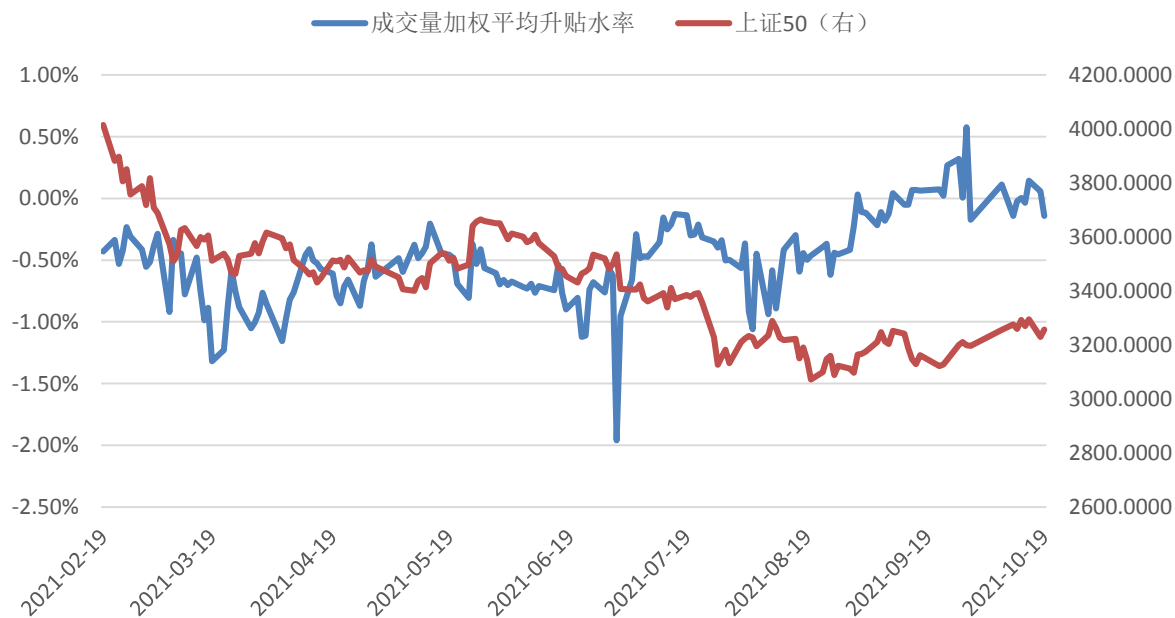
3.期指升贴水变化

3.1 沪深 300 指数期货



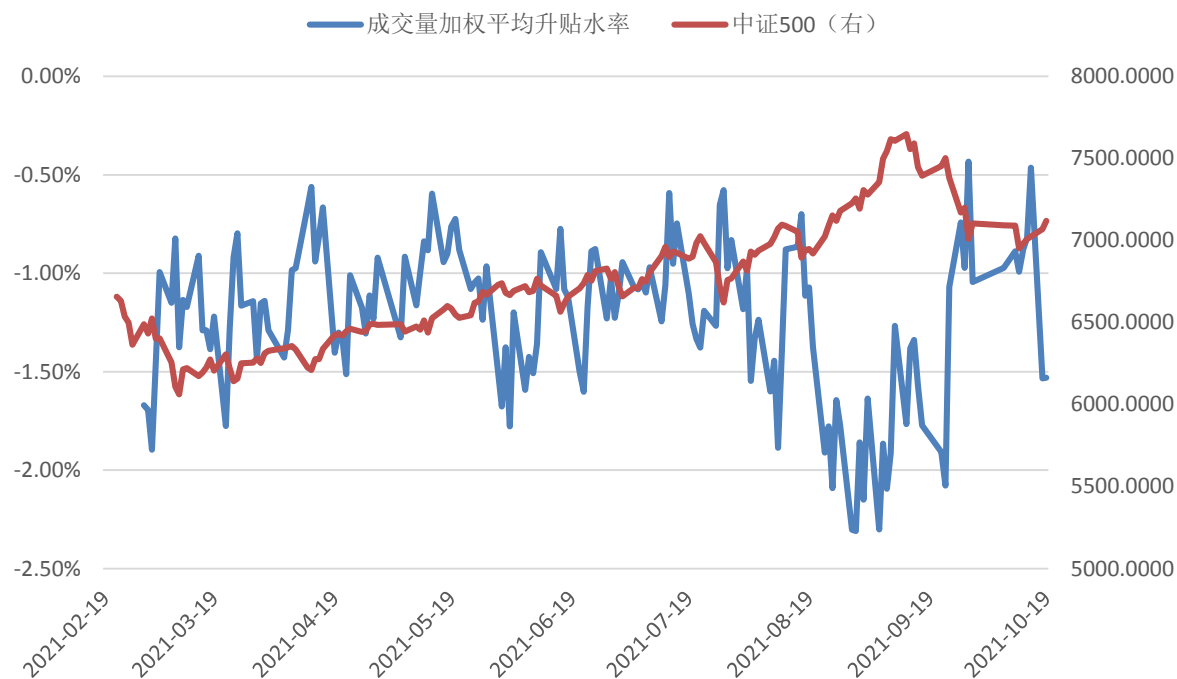
数据来源：Wind，南华研究

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，但我公司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