股指期货日报

2020 年 10 月 20 日星期二

缩量上涨

1. 图解行情

数据来源：Wind，南华研究

今天期指震荡走高。 IC 主力收涨 1.50%，IF 主力收涨 0.76%，IH 主力收涨 0.08%。

昨日市场情绪走弱，今日开盘指数低位震荡，午后指数震荡后走高，但是全天两市成交额仅 6600 亿元,北向资金净流出超 11 亿元,量能较昨日进一步衰减。三大期指升贴水未有明显变化，说明市场情绪仍旧位于低位附近。

我们继续维持指数继续上涨的动力仍在的观点，但是短期指数恐在市场情绪走弱的状况下陷入震荡。

南华期货研究所

王梦颖
0571-81727107
wangmengying@nawaa.com
投资咨询证号：Z0015429

2. 行情概览

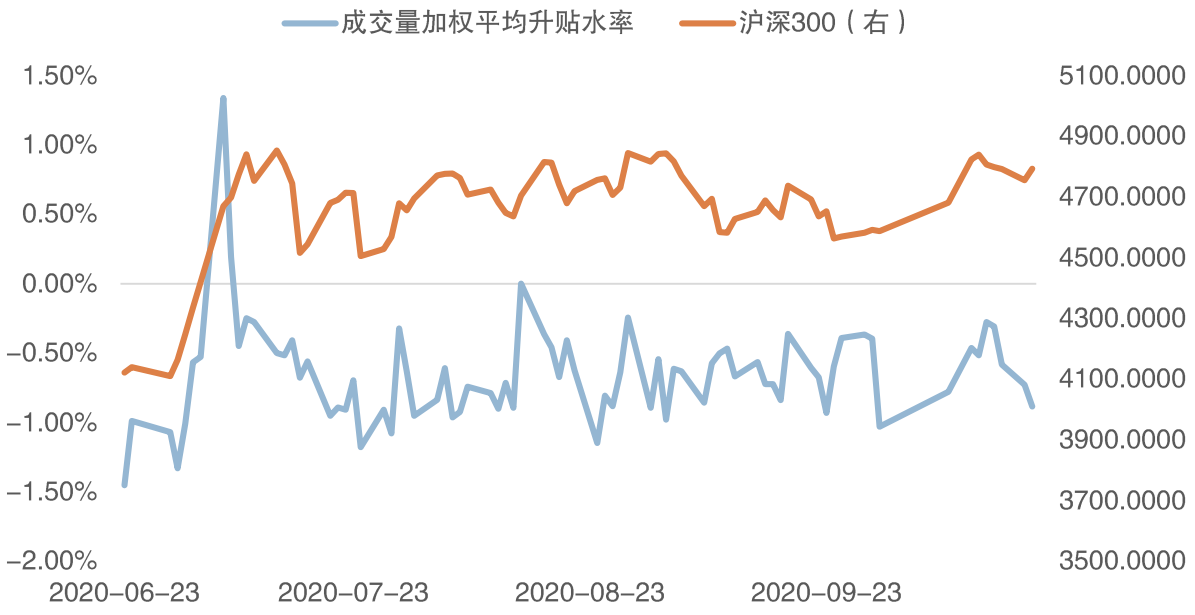
1.1 股指期货日内基本行情

沪深 300 指数期货 IF					
代码	IF00.CFE	IF01.CFE	IF02.CFE	IF03.CFE	000300.SH
简称	当月	次月	当季	下季	现货
日涨跌幅（%）	0.76	0.74	0.63	0.43	0.80
成交量（手）	60,583.00	15,778.00	3,701.00	937.00	N.A.
持仓量（手）	73,451.00	78,521.00	22,750.00	1,649.00	N.A.
持仓量变化（手）	-8,969.00	-1,850.00	29.00	400.00	N.A.
上证 50 指数期货 IH					
代码	IH00.CFE	IH01.CFE	IH02.CFE	IH03.CFE	000016.SH
简称	当月	次月	当季	下季	现货
日涨跌幅（%）	0.08	-0.02	-	-0.01	0.27
成交量（手）	23,385.00	7,465.00	1,854.00	147.00	N.A.
持仓量（手）	29,648.00	33,034.00	8,886.00	320.00	N.A.
持仓量变化（手）	-3,352.00	-1,063.00	-265.00	62.00	N.A.
中证 500 指数期货 IC					
代码	IC00.CFE	IC01.CFE	IC02.CFE	IC03.CFE	000905.SH
简称	当月	次月	当季	下季	现货
日涨跌幅（%）	1.50	1.41	1.35	1.31	1.02
成交量（手）	65,871.00	18,566.00	7,040.00	4,015.00	N.A.
持仓量（手）	89,540.00	80,373.00	43,003.00	5,685.00	N.A.
持仓量变化（手）	-5,391.00	-2,130.00	-1,433.00	1,532.00	N.A.

数据来源：Wind，南华研究

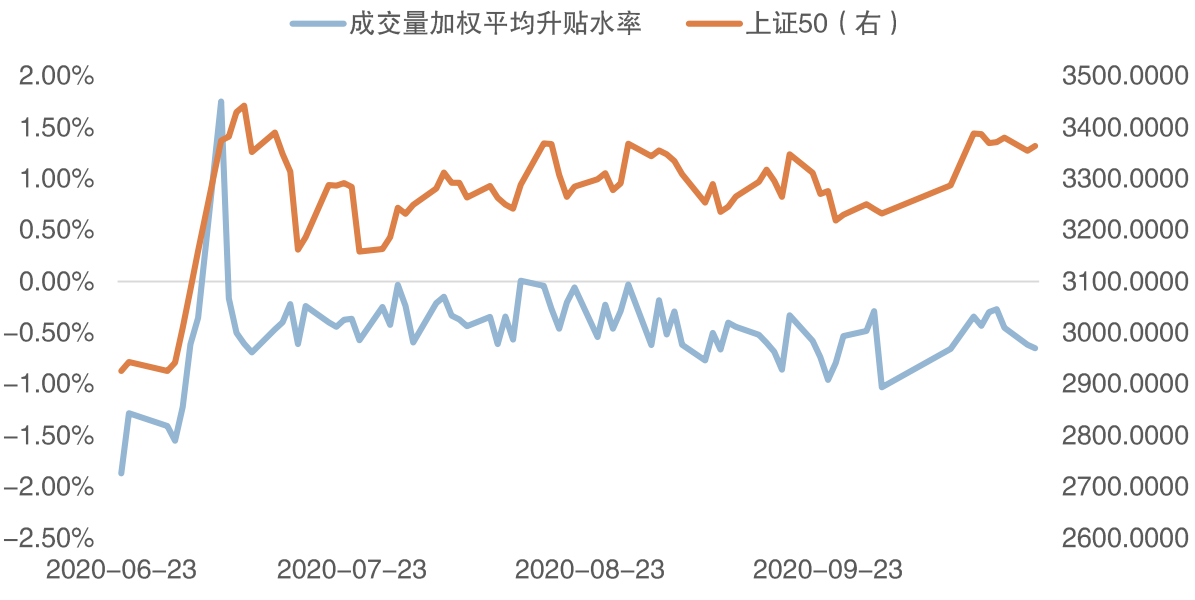
3. 期指升贴水变化

2.1 沪深 300 指数期货



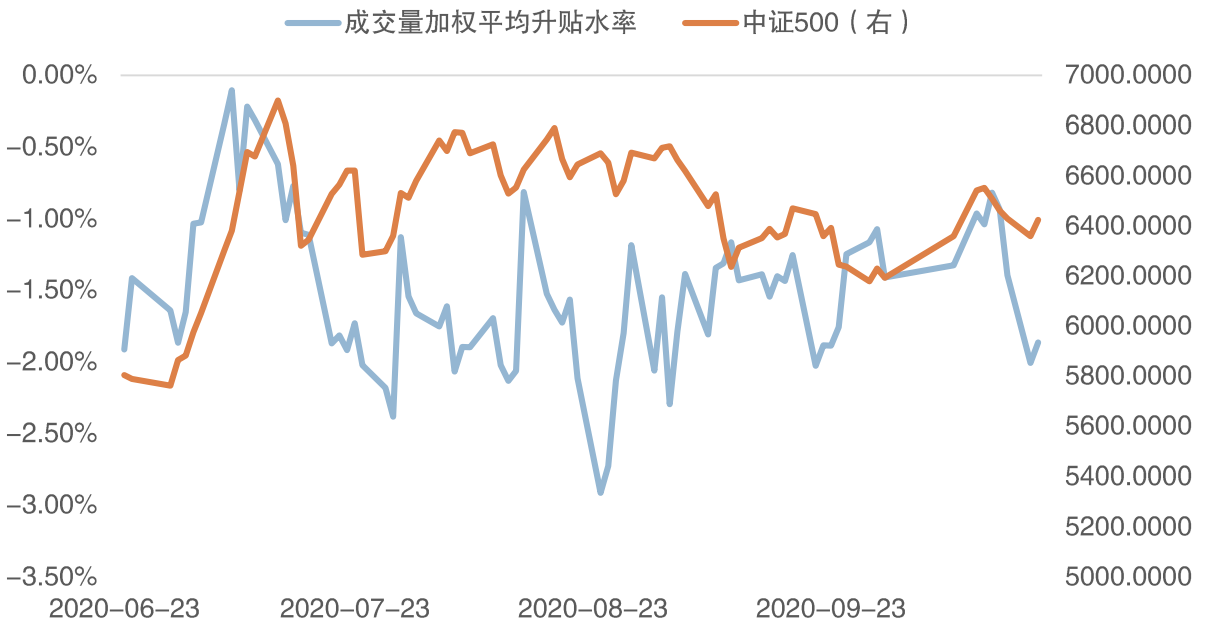
数据来源：Wind，南华研究

2.2 上证 50 指数期货



数据来源：Wind，南华研究

图 2.3 中证 500 指数期货



数据来源：Wind，南华研究

免责申明

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“南华期货公司”，并保留我公司的一切权利。

南华期货 NANHUA FUTURES

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：400　8888　910

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