

股指期货日报

2021 年 9 月 10 日星期五



南华期货研究所 张思仪

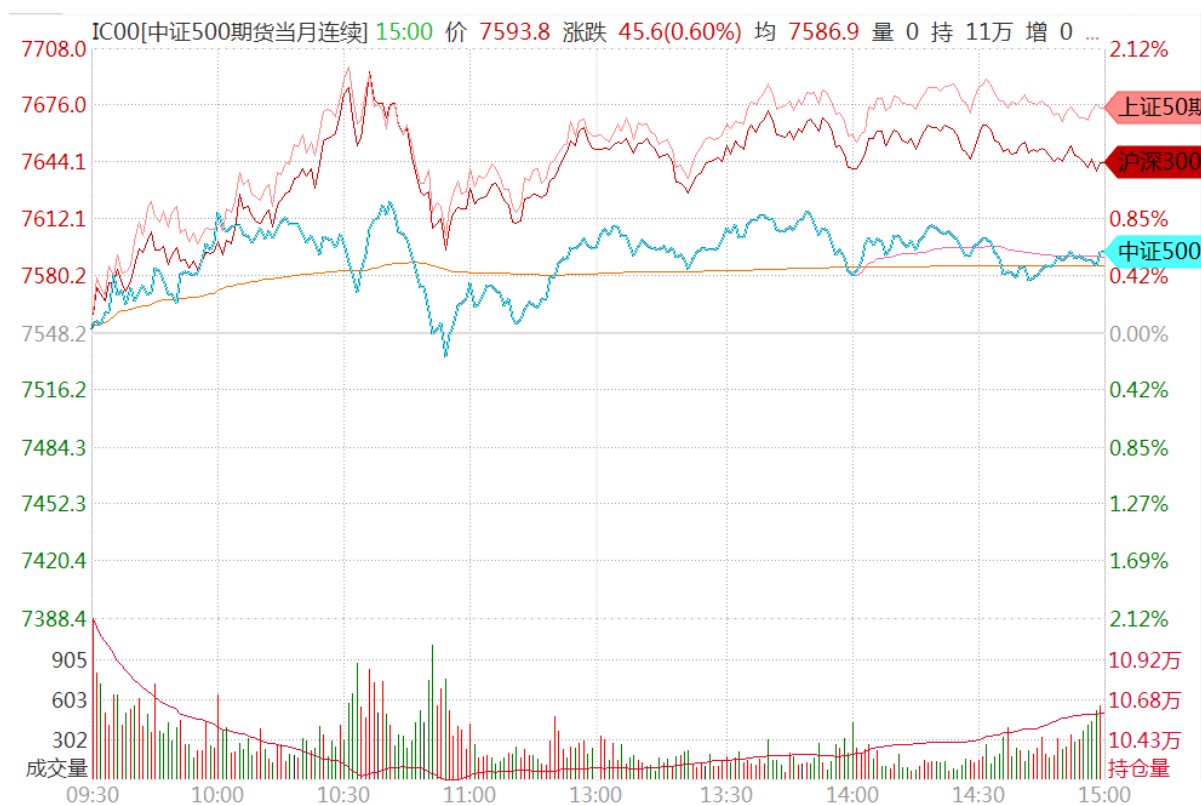
0571-81727107

zhangsiyi@nawaa.com

投资咨询证号: Z0013854

沪指收盘点位创 6 年来新高

1. 图解行情



来源: WIND 南华研究

每日观察:

今天 A 股三大指数震荡收涨。沪指涨 0.27%，收于 3703.11 点，站上了 3700 点。深证成指涨 0.50%，创业板指涨 0.31%。有色、半导体、银行等板块领涨。两市成交 1.54 万亿元，成交金额

比前些天增加 1 千多亿元，北向资金净买入 36.19 亿元。万得全 A 成份股中涨停家数继续降至 66 家，但跌停数目仍只有 4 家，涨跌家数比更是达到 0.49，市场悲观情绪得到一定的释放。期指方面，今天期指大幅上涨，IF 主力涨 1.28%，IH 涨 1.68%，IC 涨 0.60%，成交量大幅放大，贴水收窄，IH 更是重现升水。

今天上午国家主席习近平应约同美国总统拜登通电话，就中美关系和双方关心的有关问题进行了坦诚、深入、广泛的战略性沟通 and 交流。双方一致认为，中美元首就中美关系和重大国际问题深入沟通对引领中美关系正确发展非常重要，同意继续通过多种方式保持经常性联系，将责成双方工作层加紧工作、广泛对话，为中美关系向前发展创造条件。受消息提振，股指午盘探底回升，今天半导体板块也领涨。受中美对话影响，大盘的走势比我们预计要强一些，中美合作预期也可能带来更长期的影响。从盘面上看，今天 A 股出现放量，沪指收盘点位创 6 年以来的收盘价新高，高于今年 2 月大跌前的收盘价格，期指成交量也大幅增加。叠加楼市、财富管理、北向等增量资金入场，股指仍有上行动能。

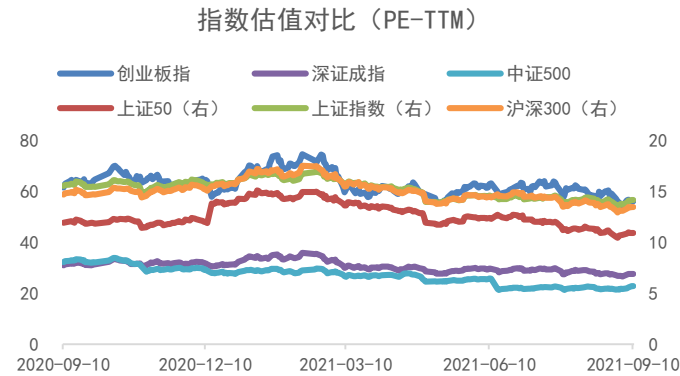
2. 行情概览

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	5016.8	1.275839793	100736	30420	107351	5517	2021-09-17	7	3.2781	-11.2133
	IF01.CFE	4998.2	1.313495764	9814	2907	18407	3367	2021-10-15	35	-15.3219	-31.0133
	IF02.CFE	4959.4	1.381904411	23198	8331	65872	6385	2021-12-17	98	-54.1219	-73.6133
	IF03.CFE	4928	1.465985834	3844	822	18957	322	2022-03-18	189	-85.5219	-109.6133
IH	IH00.CFE	3256.2	1.679990007	62027	20665	62861	985	2021-09-17	7	3.8754	-1.0782
	IH01.CFE	3253	1.65625	6197	2467	11214	1515	2021-10-15	35	0.6754	-4.2782
	IH02.CFE	3246.8	1.729540043	13773	3863	31563	971	2021-12-17	98	-5.5246	-11.6782
	IH03.CFE	3235	1.787175131	2949	1045	7635	-6	2022-03-18	189	-17.3246	-24.8782
IC	IC00.CFE	7593.8	0.604117538	68820	11402	105957	-6425	2021-09-17	7	-13.8749	-56.6505
	IC01.CFE	7533.6	0.846005569	14233	3576	26274	4164	2021-10-15	35	-74.0749	-132.8505
	IC02.CFE	7382.8	1.065023956	24175	5995	98602	3593	2021-12-17	98	-224.8749	-293.6505
	IC03.CFE	7183.2	1.035219984	8814	1266	54609	782	2022-03-18	189	-424.4749	-486.6505

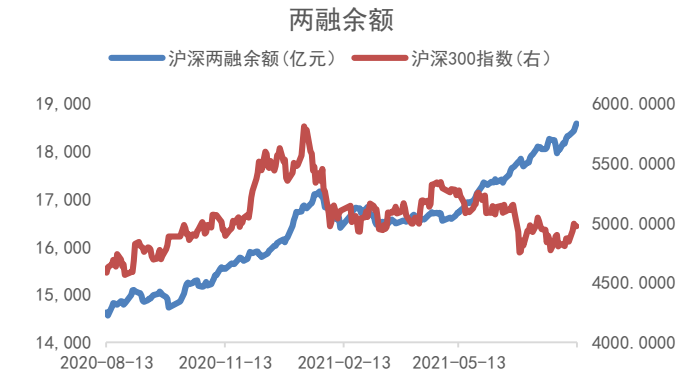
数据来源：Wind，南华研究

图 2.1 估值情况



资料来源：Wind 资讯 南华研究

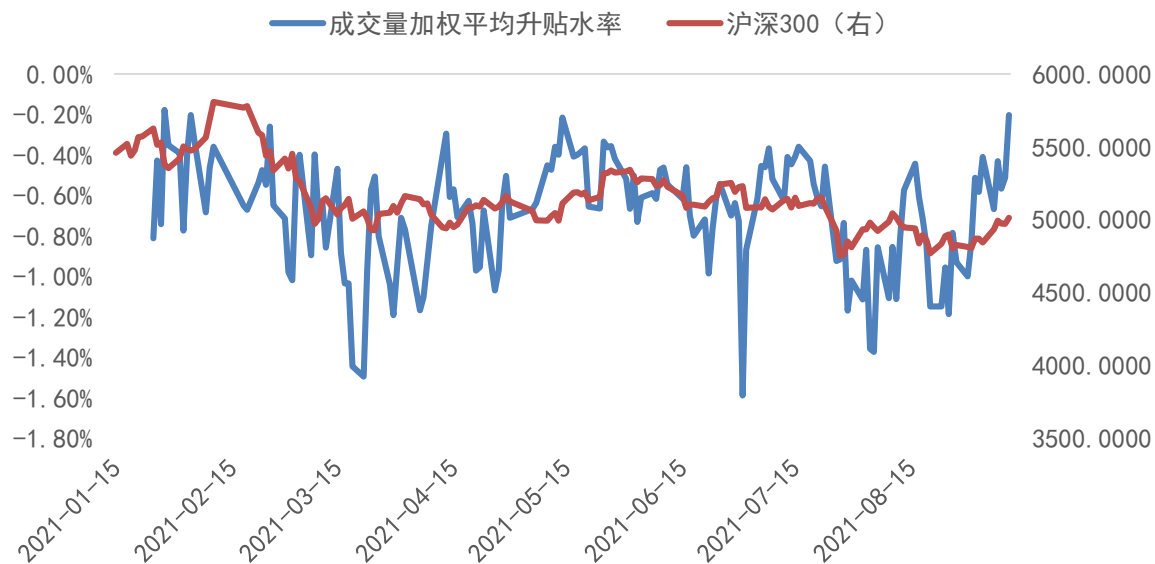
图 2.2 融资融券



资料来源：Wind 资讯 南华研究

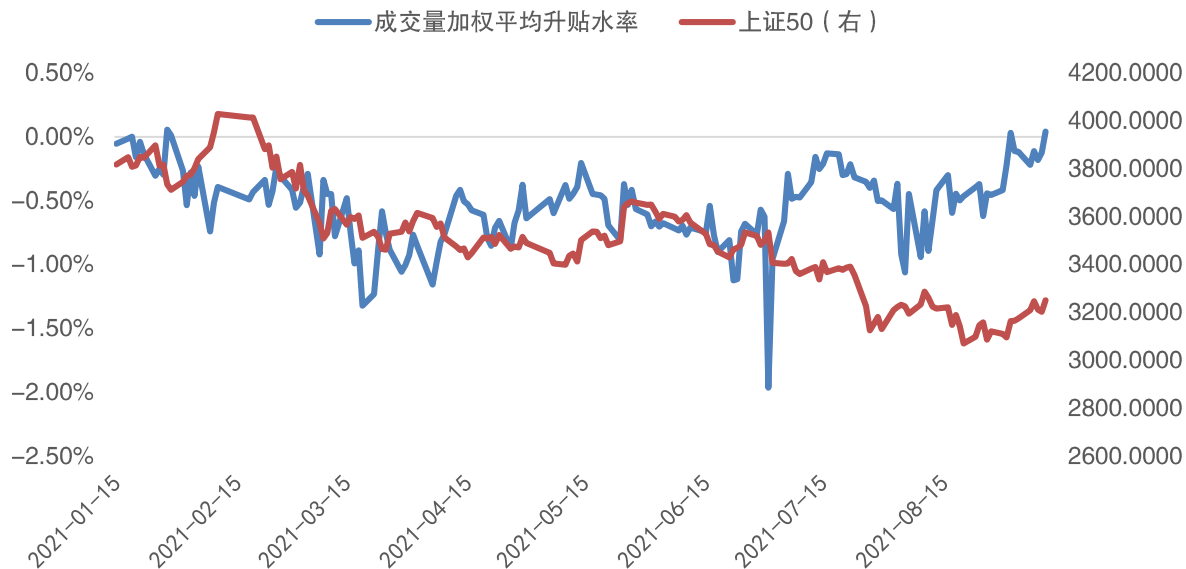
3.期指升贴水变化

3.1 沪深 300 指数期货



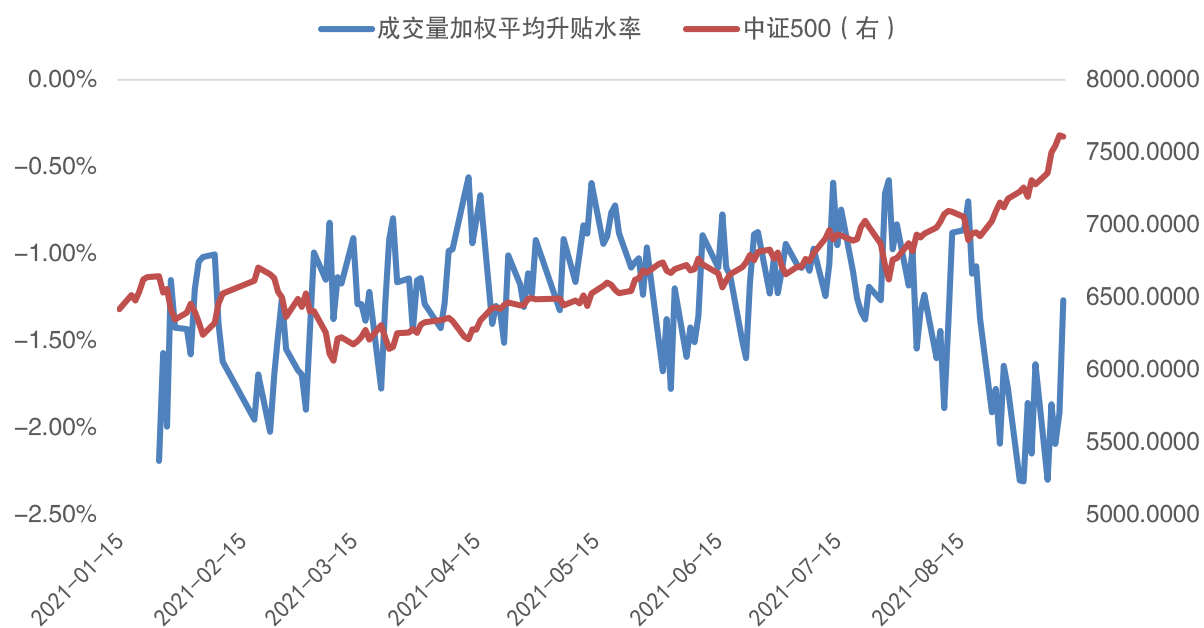
数据来源：Wind，南华研究

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