

股指期货日报

2021 年 10 月 15 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

期指延续反弹

1. 图解行情



来源: WIND 南华研究

每日观察:

今天 A 股三大股指低开高走, 延续反弹, 收盘沪指涨 0.40%, 深证成指涨 0.52%, 创业板指涨 1.88%。煤炭、新能源板块领涨。万得全 A 指数成份中涨停家数 44 家, 跌停 39 家, 跌停家数

上升,涨跌家数比 0.41,赚钱效应差。两市成交金额扩大至 9890 亿元。港交所在连续两天休市后,今天恢复交易,北向资金净买入 26.93 亿元。期指方面,IF 主力涨 0.33%,IH 涨 0.53%,IC 涨 0.10%,期指成交量变化不大,贴水收窄。

10 月 16 日出版的第 20 期《求是》杂志将发表中共中央总书记、国家主席、中央军委主席习近平的重要文章《扎实推动共同富裕》。文章提到,到“十四五”末,全体人民共同富裕迈出坚实步伐,居民收入 and 实际消费水平差距逐步缩小。到 2035 年,全体人民共同富裕取得更为明显的实质性进展,基本公共服务实现均等化。到本世纪中叶,全体人民共同富裕基本实现,居民收入 and 实际消费水平差距缩小到合理区间。还提到扩大中等收入群体比重,增加低收入群体收入,合理调节高收入,取缔非法收入,形成中间大、两头小的橄榄型分配结构,加强对高收入的规范和调节。随着相关政策的施行,我国人民消费能力长期有望增长,利好期指。

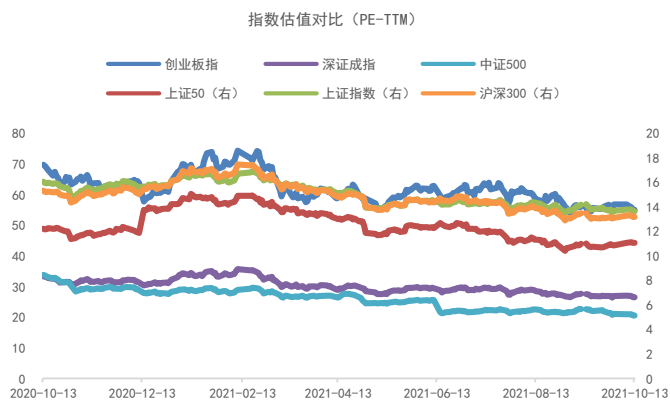
行情概览

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	4930.8	0.329630082	21795	-25455	0	-25139	2021-10-15	0	-1.3084	-6.4123
	IF01.CFE	4933	0.529855309	57139	20445	64465	17140	2021-11-19	35	0.8916	-12.4123
	IF02.CFE	4920.4	0.498366013	21150	2517	81159	2229	2021-12-17	63	-11.7084	-22.6123
	IF03.CFE	4897	0.603993755	5392	2454	28670	1870	2022-03-18	154	-35.1084	-51.6123
IH	IH00.CFE	3293.6	0.531103107	15100	-11727	0	-17606	2021-10-15	0	-1.2333	-3.492
	IH01.CFE	3301	0.670936261	38642	16762	40601	15124	2021-11-19	35	6.1667	1.308
	IH02.CFE	3303.2	0.762613629	13861	1855	42804	2034	2021-12-17	63	8.3667	0.308
	IH03.CFE	3295	0.702933985	3018	606	11650	531	2022-03-18	154	0.1667	-5.292
IC	IC00.CFE	7025	0.099743517	24970	-21468	0	-27956	2021-10-15	0	0.8404	-2.1326
	IC01.CFE	7019.8	0.69426514	49469	11458	78025	15473	2021-11-19	35	-4.3596	-47.9326
	IC02.CFE	6969.6	0.780843311	22246	-814	112161	-482	2021-12-17	63	-54.5596	-100.9326
	IC03.CFE	6808.8	0.874099973	9561	291	75426	1262	2022-03-18	154	-215.3596	-265.3326

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

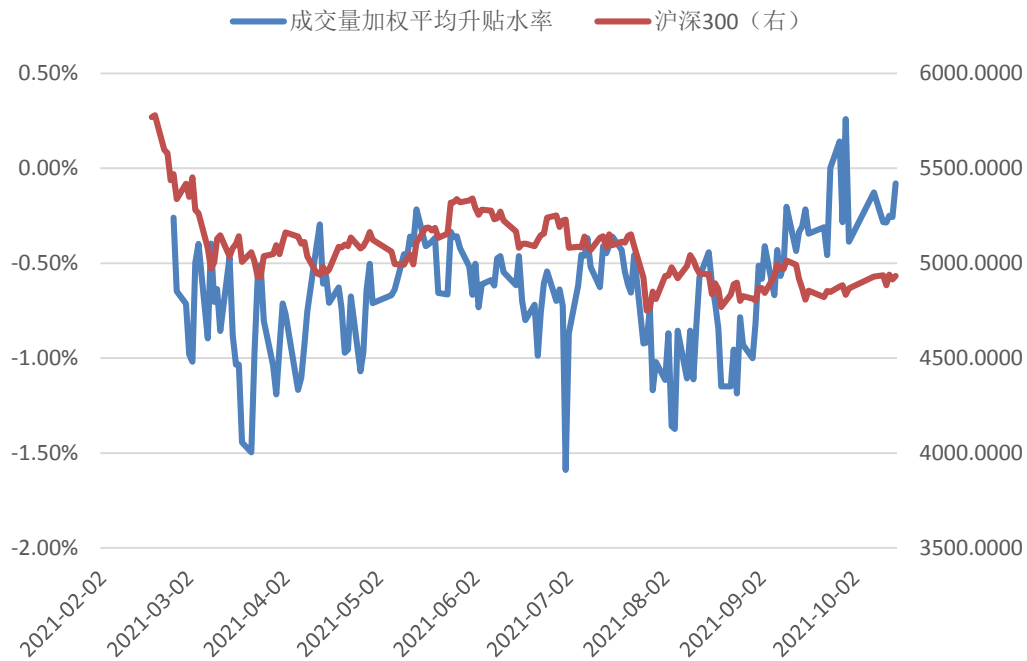
图 2.2 融资融券



资料来源：Wind 资讯 南华研究

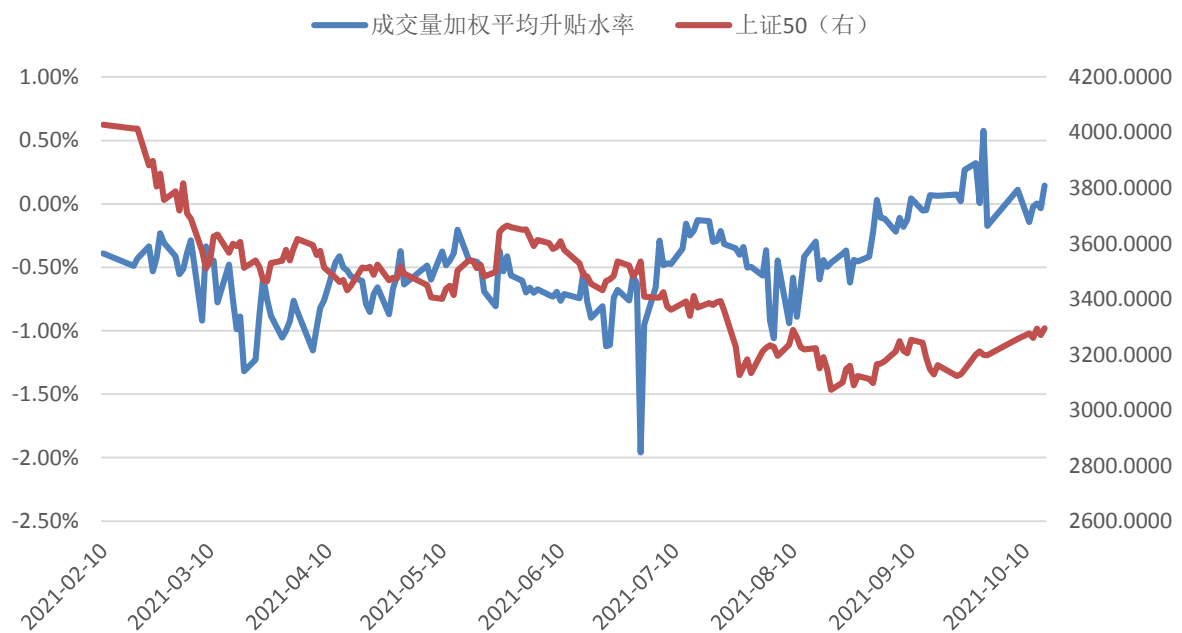
3.期指升贴水变化

3.1 沪深 300 指数期货



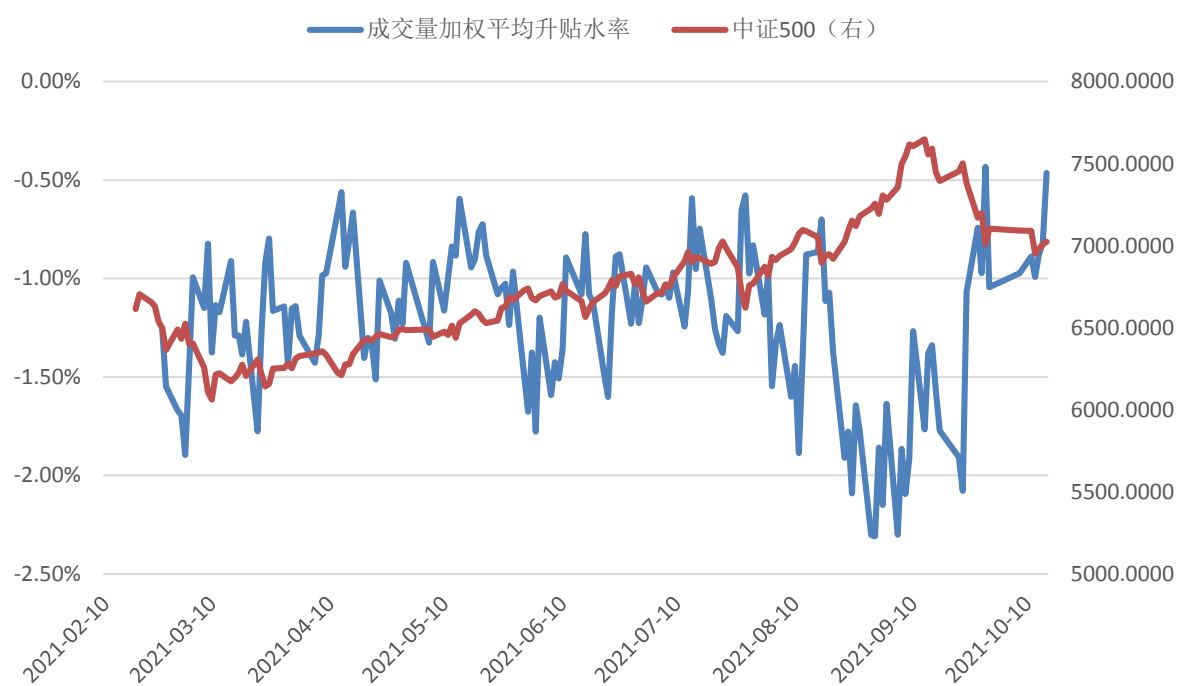
数据来源：Wind，南华研究

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