

2017年04月21日

股指期货早报

发展研究中心股指组

联系电话: 020-85598360

关注企稳

股指期货合约行情数据

行情数据(成交-手;持仓-手)

品种	合约	收盘价	涨跌幅(%)	成交	△成交	持仓	△持仓
IF	IF1704	3458.60	0.48	10235	-4847	6149	-7448
	IF1705	3441.60	0.51	12756	3462	23419	6164
	IF1706	3422.20	0.62	1908	-292	12977	-53
	IF1709	3365.60	0.78	1044	125	5463	20
	合计			25943	-1552	48008	-1317
IH	IH1704	2332.60	0.44	5414	-1189	3492	-4195
	IH1705	2325.20	0.47	5116	312	15619	3176
	IH1706	2309.40	0.33	611	-286	7310	51
	IH1709	2261.00	0.21	531	73	4415	267
	合计			11672	-1090	30836	-701
IC	IC1704	6347.80	0.03	7678	-3985	5141	-5553
	IC1705	6312.20	0.08	8791	1864	15883	4273
	IC1706	6278.80	0.26	1746	-103	10197	54
	IC1709	6190.00	0.45	546	-93	5221	-2
	合计			18761	-2317	36442	-1228

股指期货合约基差数据

基差数据(-点)

品种	合约	交割日	剩余天数	前一日基差	最新基差
IF	IF1704	2017/4/21	1	6	3
	IF1705	2017/5/19	29	25	20
	IF1706	2017/6/16	57	54	39
	IF1709	2017/9/16	149	107	96
IH	IH1704	2017/4/21	1	3	3
	IH1705	2017/5/19	29	11	10
	IH1706	2017/6/16	57	26	26
	IH1709	2017/9/16	149	68	75
IC	IC1704	2017/4/21	1	4	0
	IC1705	2017/5/19	29	40	36
	IC1706	2017/6/16	57	95	69
	IC1709	2017/9/16	149	194	158

注: 基差=现货价格-期货价格

财经要闻

外管局: 跨境资金流出压力明显减轻。中国外汇管理不会走回头路, 不会再到资本管制的老路上; 会继续审慎有序推动中国资本账户开放; 将构建跨境资本流动的宏观审慎管理和微观市场监管体系, 维护健康、稳定、良性的外汇市场秩序; 进一步完善汇率形成机制, 增强汇率弹性。

交易提示

本报告中的信息均来源于已公开的资料, 我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证, 不保证该信息未经任何更新, 也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下, 报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。投资者据此投资, 风险自担。未经我司书面授权, 任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或对本报告进行有悖原意的删节和修改。**期市有风险 入市需谨慎!**

股指期货合约净持仓数据

持仓数据(手)						
品种	前5净持仓	前10净持仓	前20净持仓	前5变动	前10变动	前20变动
IF	0	0	0	167	194	-1,034
IH	0	0	0	-513	-1001	-588
IC	0	0	0	-63	311	850
			0	-409	-496	-772

注：净持仓=多头持仓-空头持仓，前5净持仓变动为最近一个交易日与上一交易日之差

本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。投资者据此投资，风险自担。未经我司书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或对本报告进行有悖原意的删节和修改。**期市有风险 入市需谨慎!**

[市场表现]

周四上证综指收盘涨 0.04%报 3172.10 点，深成指涨 0.10%报 10359.09 点，创业板指涨 0.27%报 1850.39 点，均结束四日连跌。两市成交 4649 亿元，上日同期为 4936 亿。两融余额连跌两日。截至 4 月 19 日，A 股融资融券余额为 9342.06 亿元，较前一交易日减少 32.34 亿元。融资买入额 420.44 亿元，仍处于阶段低位。

[行情分析]

中国 3 月银行结售汇逆差 800 亿元人民币，代客结售汇逆差 483 亿元人民币；3 月银行代客结汇 9545 亿元人民币，银行代客涉外收付款逆差 1199 亿元人民币，3 月银行售汇 10798 亿元人民币；中国经常账户顺差占 GDP 比例在合理区间，未来仍会维持在合理区间。

央行马骏称，银行表外理财于一季度正式纳入 MPA 广义信贷指标范围，总体看是平稳有序的；对理财、资管业务的进一步监管，将是一个渐进的过程，监管部门会充分考虑相关政策对市场的影响。

[操作建议]

跨境资金流出压力减轻，国内资金面维持紧平衡，股指中长期继续向好。周四股指尾盘探底回升，短期能否企稳是关键，沪深 300 关注 5 日线压力。操作上建议观望为主，多单等待机会。

本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。投资者据此投资，风险自担。未经我司书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或对本报告进行有悖原意的删节和修改。**期市有风险 入市需谨慎!**