

2017年04月27日

股指期货早报

发展研究中心股指组

联系电话: 020-85598360

关注 10 日线压力

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	IF1705	3427.80	0.12	14130	571	26765	400
	IF1706	3413.20	0.16	1744	-360	13483	75
	IF1709	3353.00	0.15	662	-96	5690	134
	IF1712	3328.20	0.36	170	-39	369	65
	合计			16706	76	46307	674
IH	IH1705	2334.80	-0.03	5841	665	16877	27
	IH1706	2324.80	0.08	953	122	7121	53
	IH1709	2276.80	0.23	353	-22	4886	39
	IH1712	2255.00	0.22	82	7	134	25
	合计			7229	772	29018	144
IC	IC1705	6142.00	0.13	9484	-1267	19013	-428
	IC1706	6111.80	0.21	1412	-18	10349	-94
	IC1709	6034.80	0.34	497	-172	5104	-32
	IC1712	5964.20	0.49	265	11	506	148
	合计			11658	-1446	34972	-406

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	IF1705	2017/5/19	23	18	17
	IF1706	2017/6/16	51	34	32
	IF1709	2017/9/15	142	94	92
	IF1712	2017/12/16	234	125	117
IH	IH1705	2017/5/19	23	10	10
	IH1706	2017/6/16	51	24	20
	IH1709	2017/9/15	142	74	68
	IH1712	2017/12/16	234	93	90
IC	IC1705	2017/5/19	23	32	34
	IC1706	2017/6/16	51	67	65
	IC1709	2017/9/15	142	147	142
	IC1712	2017/12/16	234	227	212

注: 基差=现货价格-期货价格

财经要闻

财政部: 一季度国有企业经济运行稳中向好; 国有企业营业总收入 116336.1 亿元, 同比增 18.5%, 利润总额 5873.1 亿元, 同比增 37.3%; 石化和交通等行业实现利润同比增幅较大。

雄安新区举行首场新闻发布会, 新区筹委会副主任牛景峰说, 新区启动区 30 平方公里, 规划设计将面向全球招标。雄安新区规划建设将坚持“世界眼光、国际标准、中国特色、高点定位”, 河北省委、省政府明确了树牢大历史观、精准把握定位, 明确提出了“1+N”规划体系。

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	-1,034	-1,515	181	-97	51	195
IH	335	789	738	31	-5	123
IC	-5	-534	-739	166	-30	-198
			180	100	16	120

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]

周三上证综指收盘涨 0.2%报 3140.85 点；深成指涨 0.39%报 10204.84 点；创业板指涨 0.09%报 18020.48 点。两市成交 4307 亿元，上日为 3869 亿。截至 4 月 25 日，A 股融资融券余额为 9154.84 亿元，较前一交易日减少 19.42 亿元，创逾一个月新低。

[行情分析]

4 月 26 日，港股通（沪）净流入 22.95 亿元，当日余额 82.05 亿元，港股通（深）净流入 4.42 亿元，当日余额 100.58 亿元，南向资金总净流入 27.37 亿元。值得关注的是，这是继 4 月 10 日南向资金净流入 20.60 亿元后，再创两周以来新高。

央行进行 400 亿 7 天、200 亿 14 天、200 亿 28 天期逆回购操作，当日净投放 400 亿。Shibor 连续六日全线上涨，7 天期 Shibor 涨 0.63bp 报 2.8203%，续创 3 月 31 日以来新高。

股指期货席位持仓方面，IF 合约前 20 席位净持仓为 181 手，较前一交易日增加了 195 手；IH 合约前 20 席位净持仓为 738 手，较前一交易日增加了 123 手；IC 合约前 20 席位净持仓为 -739 手，较前一交易日减少了 198 手。整体来看，期指前 20 席位净持仓累计增加了 120 手。

[操作建议]

前期委外赎回干扰影响逐渐消退，市场悲观情绪得到缓解。周三雄安板块王者回归，股指逐渐有企稳迹象。操作上建议可轻仓逢低做多，IF1706 关注支撑 3380 点，压力 3430 点。

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。投资者据此操作，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!**