

股指期货早报

2023年3月6日

杜淑芳

投资咨询资格证号：Z0000690

联系电话：0575-85226759

早评

期指

- 1、基本面：政府工作报告称今年GDP增长目标5%左右，把恢复和扩大消费摆在优先位置，处于市场预期下沿，证监会同意6家公司IPO注册，上周中字头股票带领沪指走强，双创板块弱势调整，市场分化；中性
- 2、资金：融资余额14911亿元，增加31亿元，沪深股通净买入7亿元；偏多
- 3、基差：IH2303升水6.69点，IF2303升水8.86点，IC2303贴水1.23点，IM2303贴水10.71点，中性
- 4、盘面：IC>IM>IF>IH（主力），IC、IM、IH、IF在20日均线上方，偏多
- 5、主力持仓：IC主力空减，IF 主力空减，IH主力空增，偏空
- 6、预期：今年GDP增速处于市场预期下沿，国防开支增加，美债收益率高位回落，美股科技股反弹，经济复苏提振中字头股票走强，港股和蓝筹股反弹，沪指突破前期压力位，不过整体上方压力明显。

股指期货升贴水表

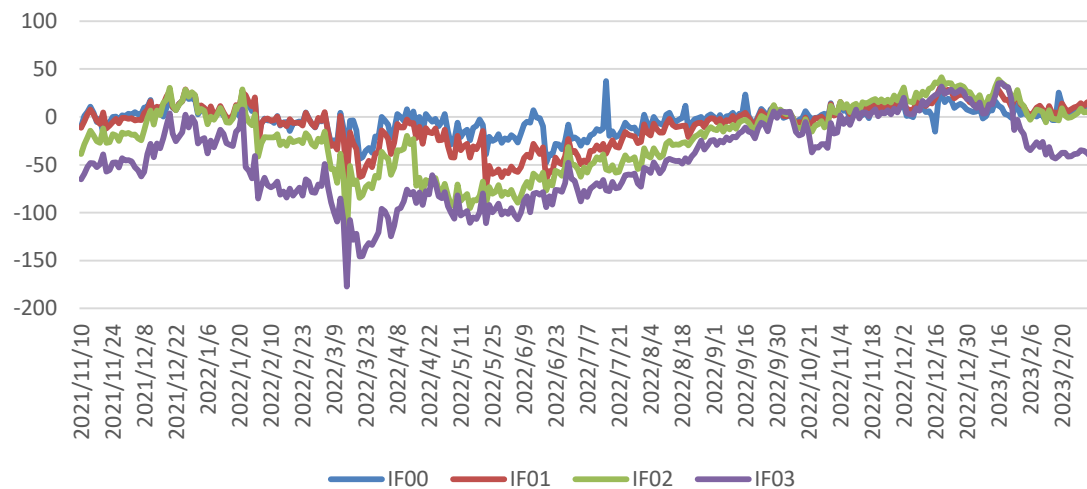
当前日期 2023/3/3

数据来源: wind, 市盈率取PE (TTM)

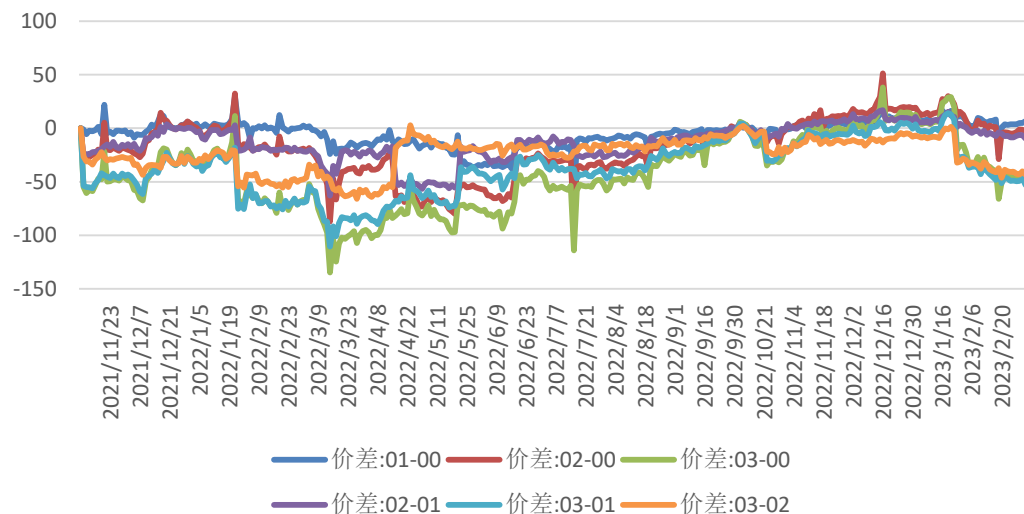
指数	代码	简称	合约价格	涨跌幅 (%)	成交量	指数价格	涨跌幅 (%)	市盈率	市净率	股息率 (%)	价差	升贴水比例	年化升贴水	合约价值(元/手)	交割日	剩余期限
上证50	IH2303.CFE	IH2303	2,777.60	0.04	38,380	2,774.51	0.20	9.88	1.31	3.75	3.09	0.11%	2.90%	833,280	2023-03-17	14
	IH2304.CFE	IH2304	2,783.60	0.08	2,286						9.09	0.33%	2.43%	835,080	2023-04-21	49
	IH2306.CFE	IH2306	2,783.80	0.12	8,314						9.29	0.33%	1.16%	835,140	2023-06-16	105
	IH2309.CFE	IH2309	2,755.00	0.10	3,461						-19.51	-0.71%	-1.32%	826,500	2023-09-15	196
指数	代码	简称	合约价格	涨跌幅 (%)	成交量	指数价格	涨跌幅 (%)	市盈率	市净率	股息率 (%)	价差	升贴水比例	年化升贴水	合约价值(元/手)	交割日	剩余期限
沪深300	IF2303.CFE	IF2303	4,134.40	0.17	58,882	4,130.55	0.31	12.16	1.43	2.66	3.85	0.09%	2.43%	1,240,320	2023-03-17	14
	IF2304.CFE	IF2304	4,140.80	0.20	58,882						10.25	0.25%	1.84%	1,242,240	2023-04-21	49
	IF2306.CFE	IF2306	4,133.00	0.21	14,313						2.45	0.06%	0.21%	1,239,900	2023-06-16	105
	IF2309.CFE	IF2309	4,089.00	0.16	4,369						-41.55	-1.02%	-1.89%	1,226,700	2023-09-15	196
指数	代码	简称	合约价格	涨跌幅 (%)	成交量	指数价格	涨跌幅 (%)	市盈率	市净率	股息率 (%)	价差	升贴水比例	年化升贴水	合约价值(元/手)	交割日	剩余期限
中证500	IC2303.CFE	IC2303	6,372.60	-0.03	40,723	6,390.32	0.13	24.58	1.83	1.71	-17.72	-0.28%	-7.25%	1,274,520	2023-03-17	14
	IC2304.CFE	IC2304	6,364.40	0.02	3,126						-25.92	-0.41%	-3.03%	1,272,880	2023-04-21	49
	IC2306.CFE	IC2306	6,310.80	0.00	12,965						-79.52	-1.26%	-4.38%	1,262,160	2023-06-16	105
	IC2309.CFE	IC2309	6,232.00	0.00	7,169						-158.32	-2.54%	-4.73%	1,246,400	2023-09-15	196
指数	代码	简称	合约价格	涨跌幅 (%)	成交量	指数价格	涨跌幅 (%)	市盈率	市净率	股息率 (%)	价差	升贴水比例	年化升贴水	合约价值(元/手)	交割日	剩余期限
中证1000	IM2303.CFE	IM2303	6,942.00	-0.19	33,740	6,967.94	-0.06	31.21	2.43	1.06	-25.94	-0.37%	-9.74%	1,388,400	2023-03-17	14
	IM2304.CFE	IM2304	6,919.40	-0.14	2,912						-48.54	-0.70%	-5.23%	1,383,880	2023-04-21	49
	IM2306.CFE	IM2306	6,841.60	-0.16	9,053						-126.34	-1.85%	-6.42%	1,368,320	2023-06-16	105
	IM2309.CFE	IM2309	6,738.00	-0.17	4,527						-229.94	-3.41%	-6.36%	1,347,600	2023-09-15	196

期货市场-沪深300基差与价差

沪深300基差

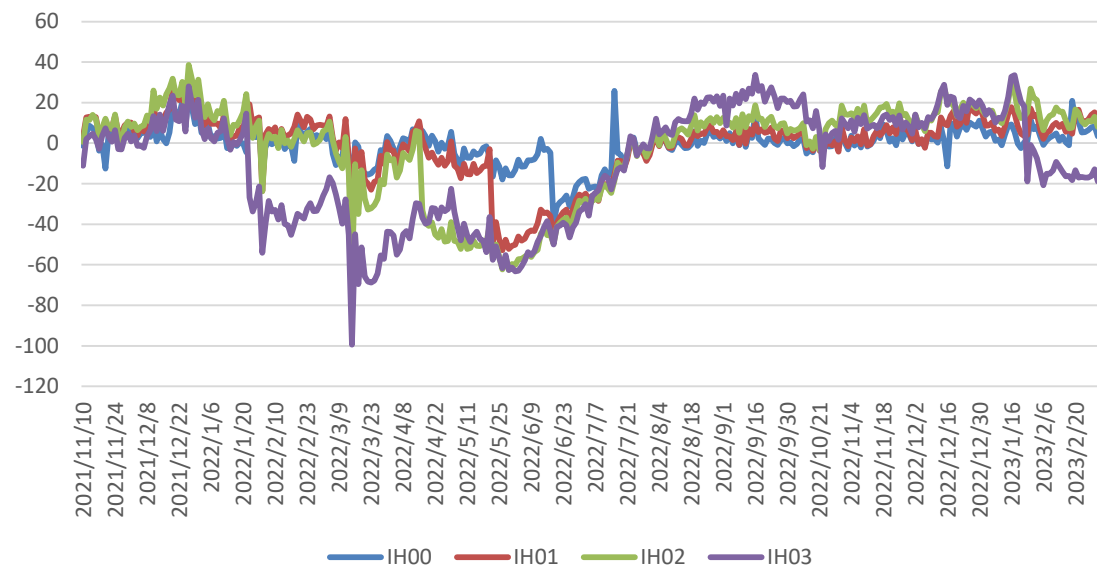


沪深300价差

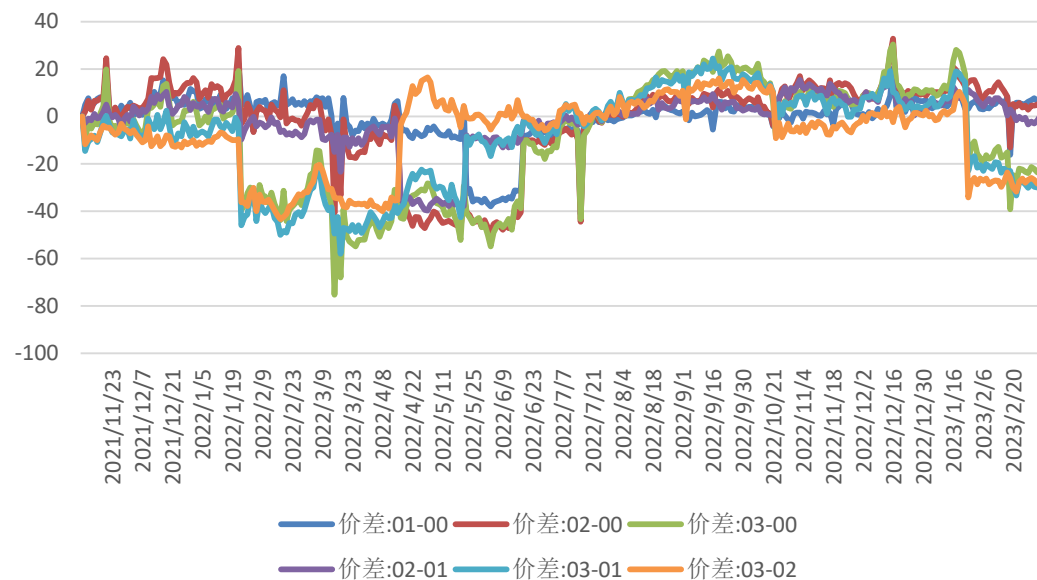


期货市场-上证50基差与价差

上证50基差

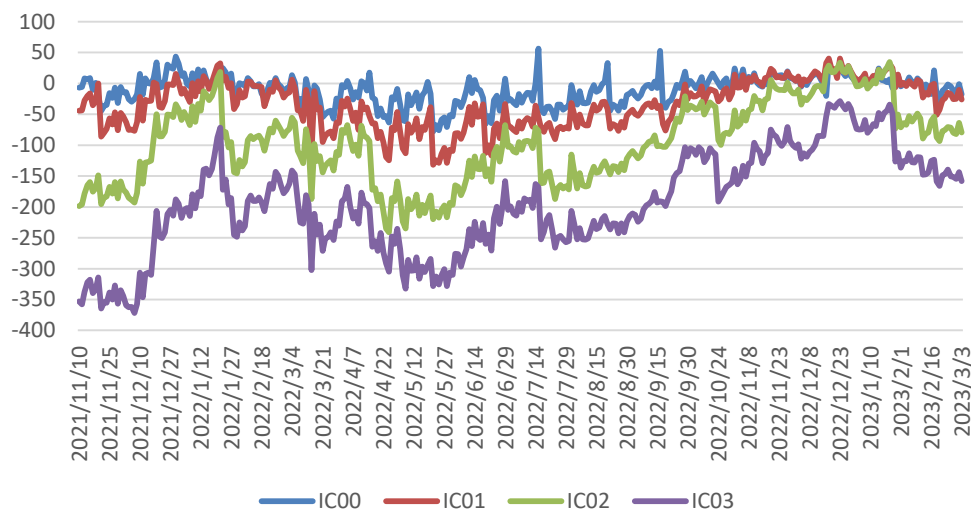


上证50价差

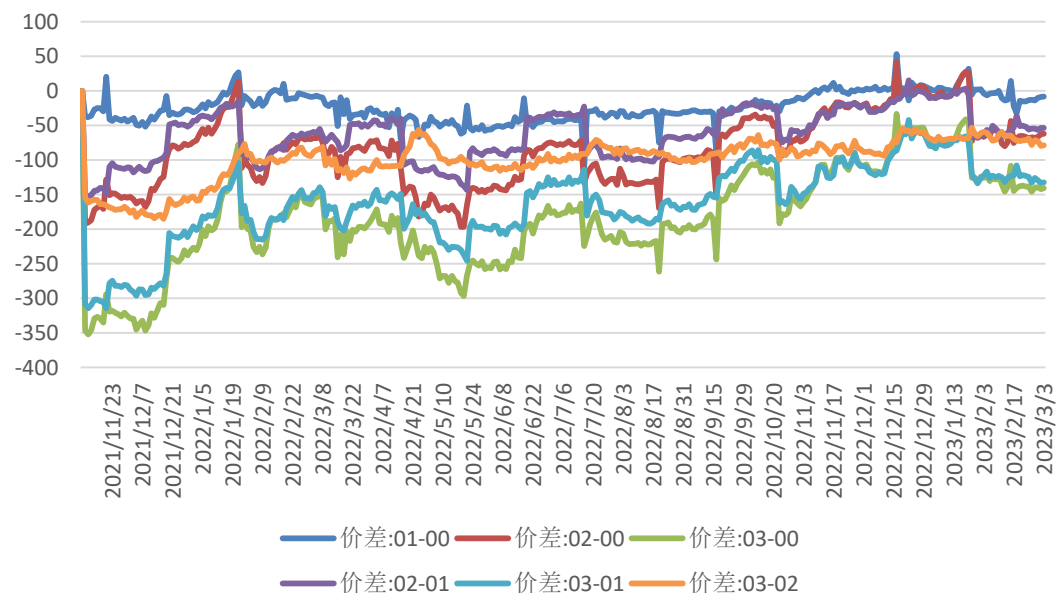


期货市场-中证500基差与价差

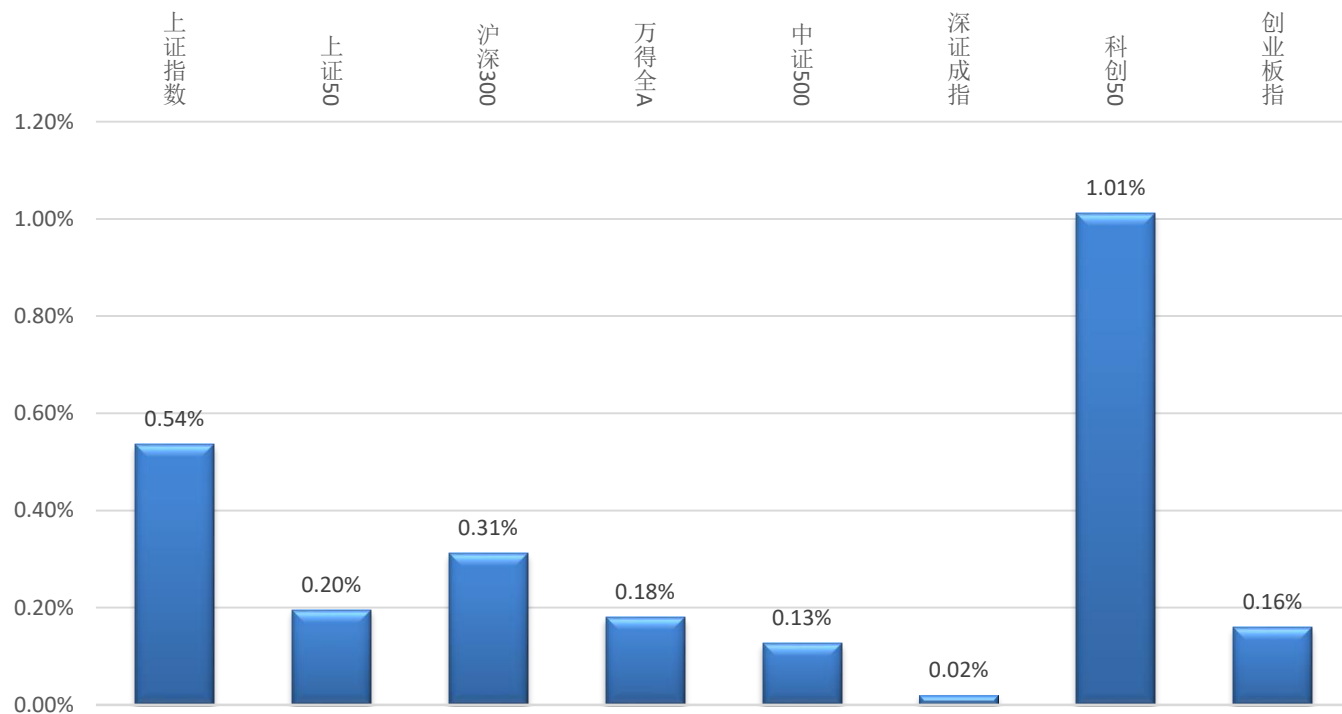
中证500基差



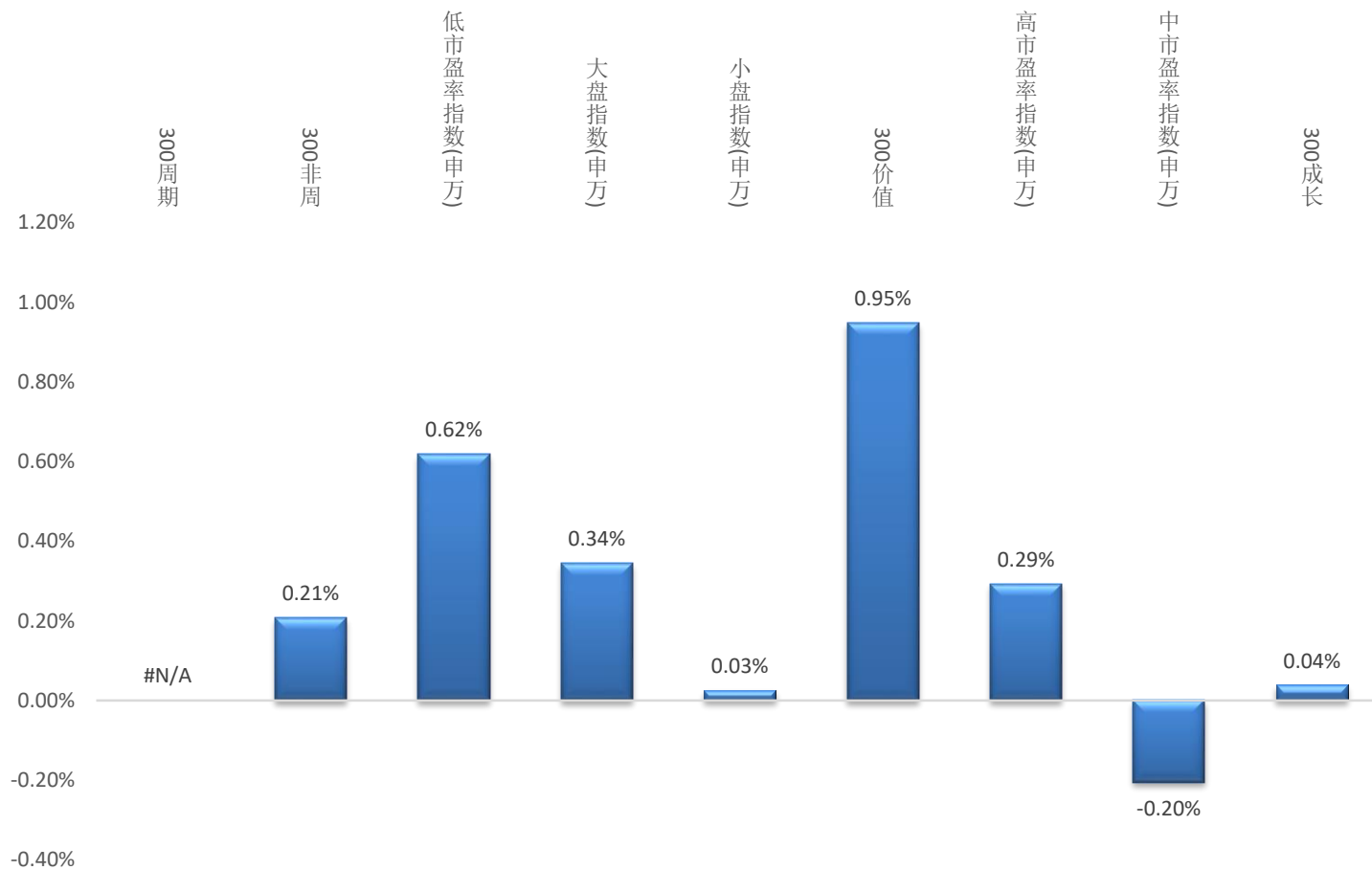
中证500价差



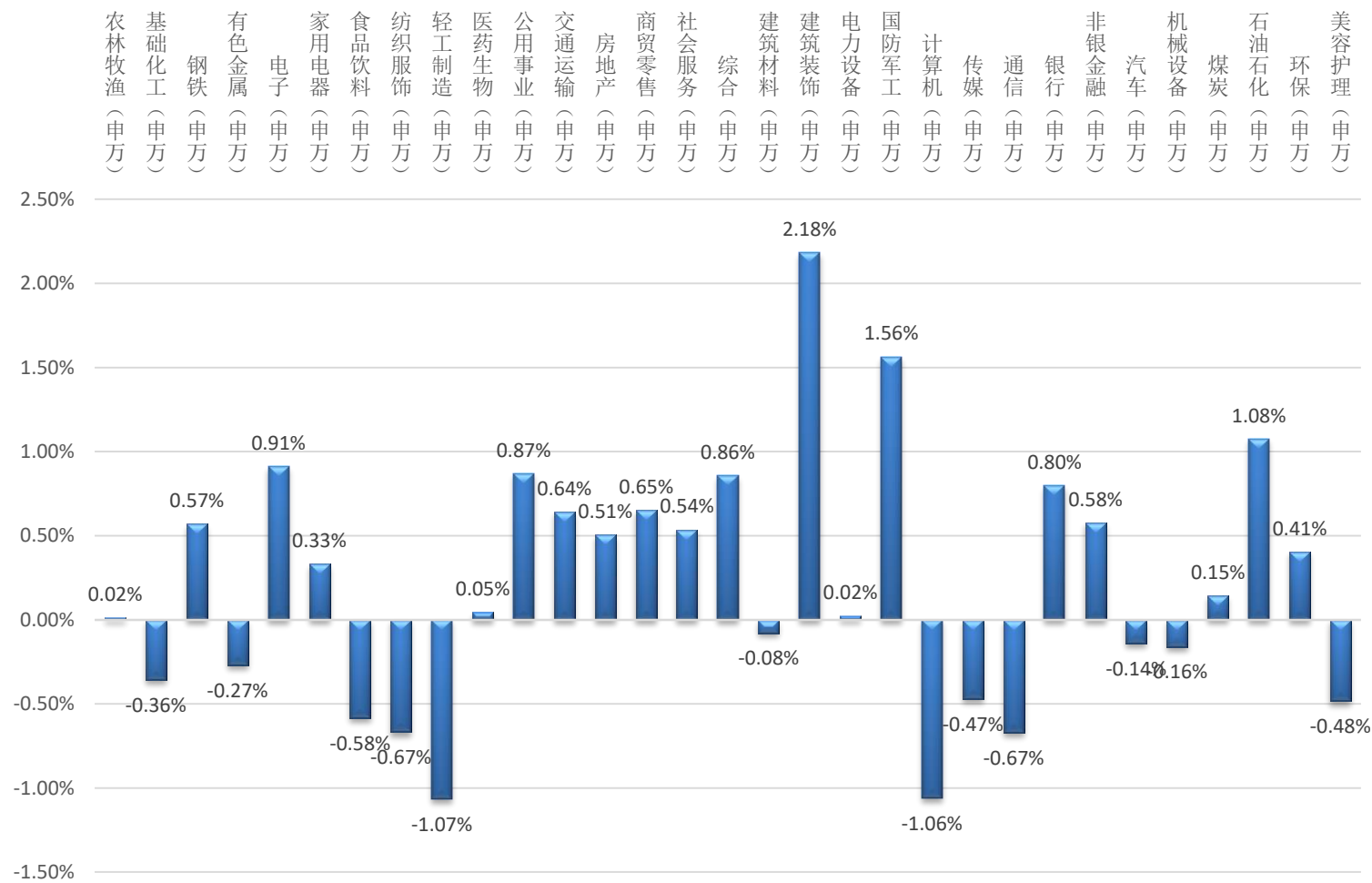
现货市场-重要指数日涨跌幅



现货市场-风格指数日涨跌幅



现货市场-风格指数日涨跌幅



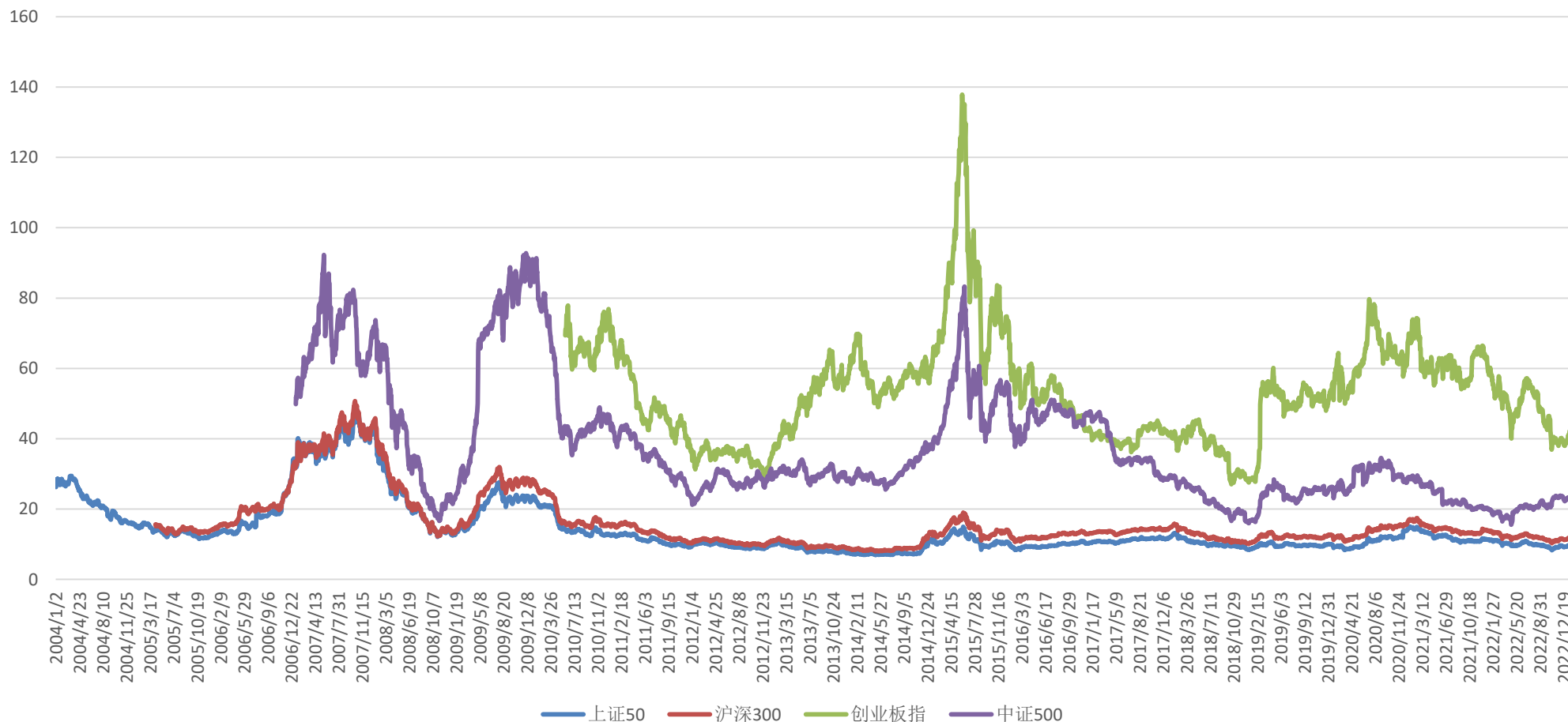
市场结构-AH股折溢价

恒生AH溢价指数



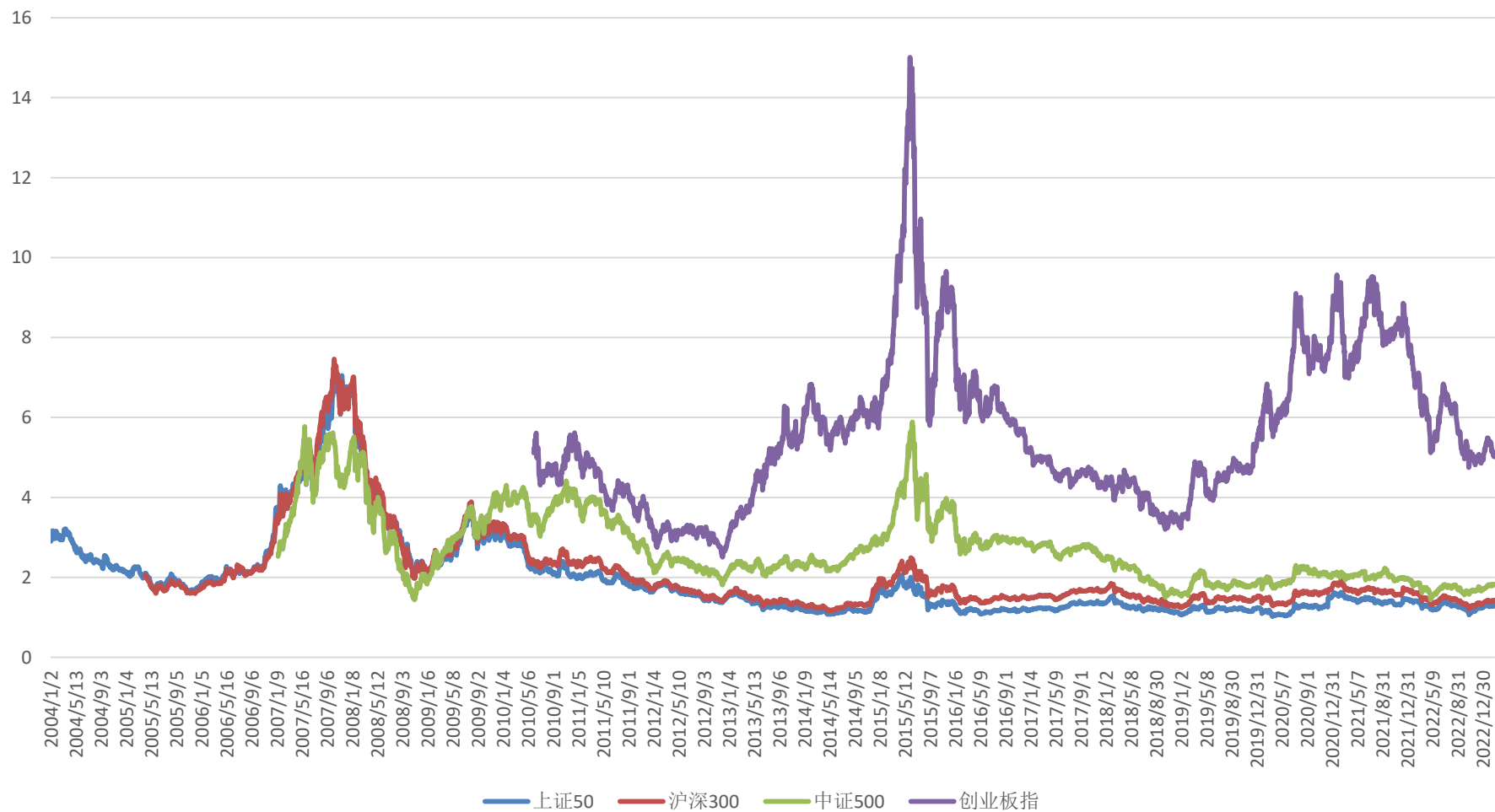
市场结构-市盈率PE（TTM）

上证50、沪深300、中证500和创业板指市盈率PE

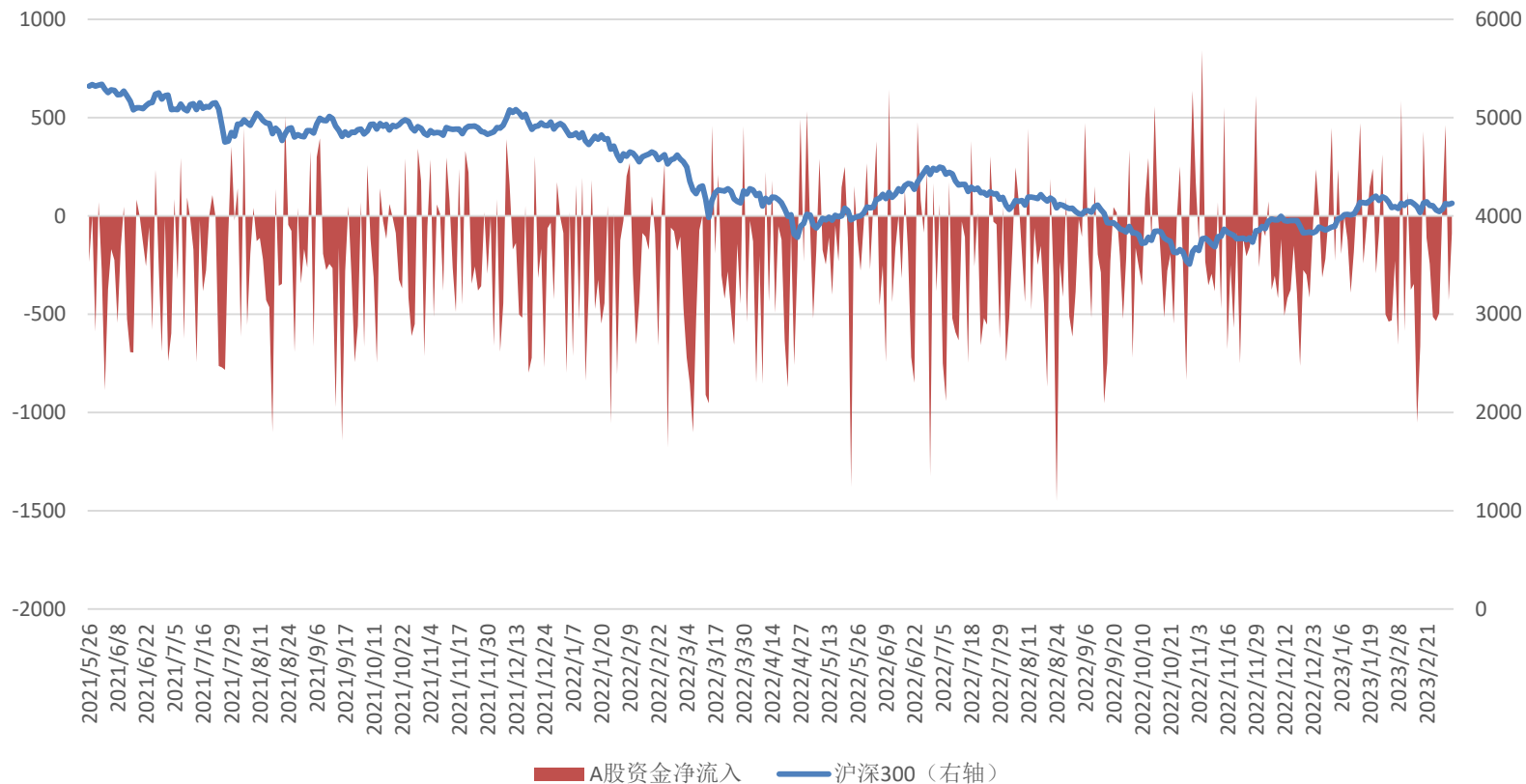


市场结构-市净率PB

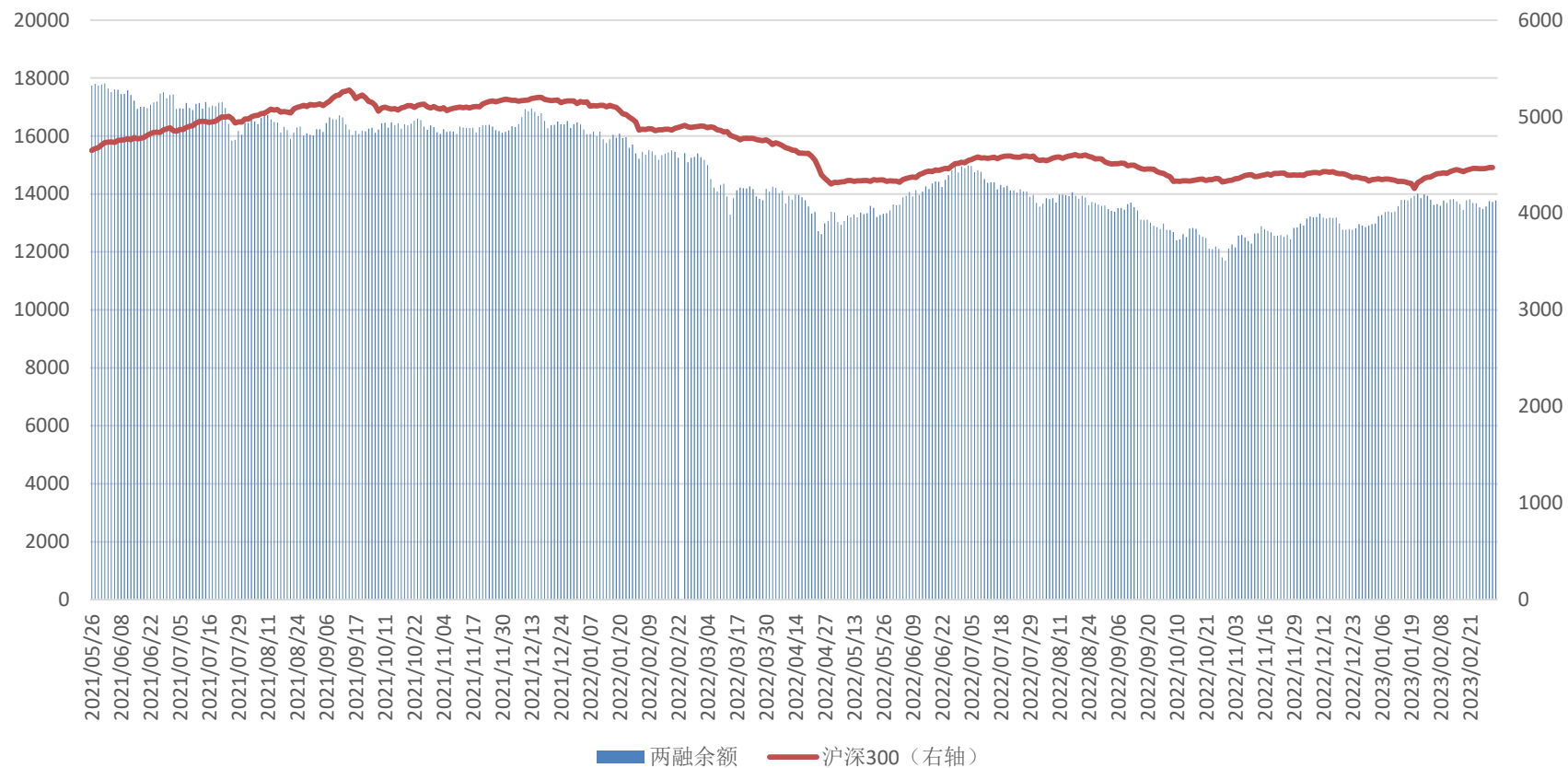
上证50、沪深300、中证500和创业板指市净率PB



市场资金面-股市资金流入

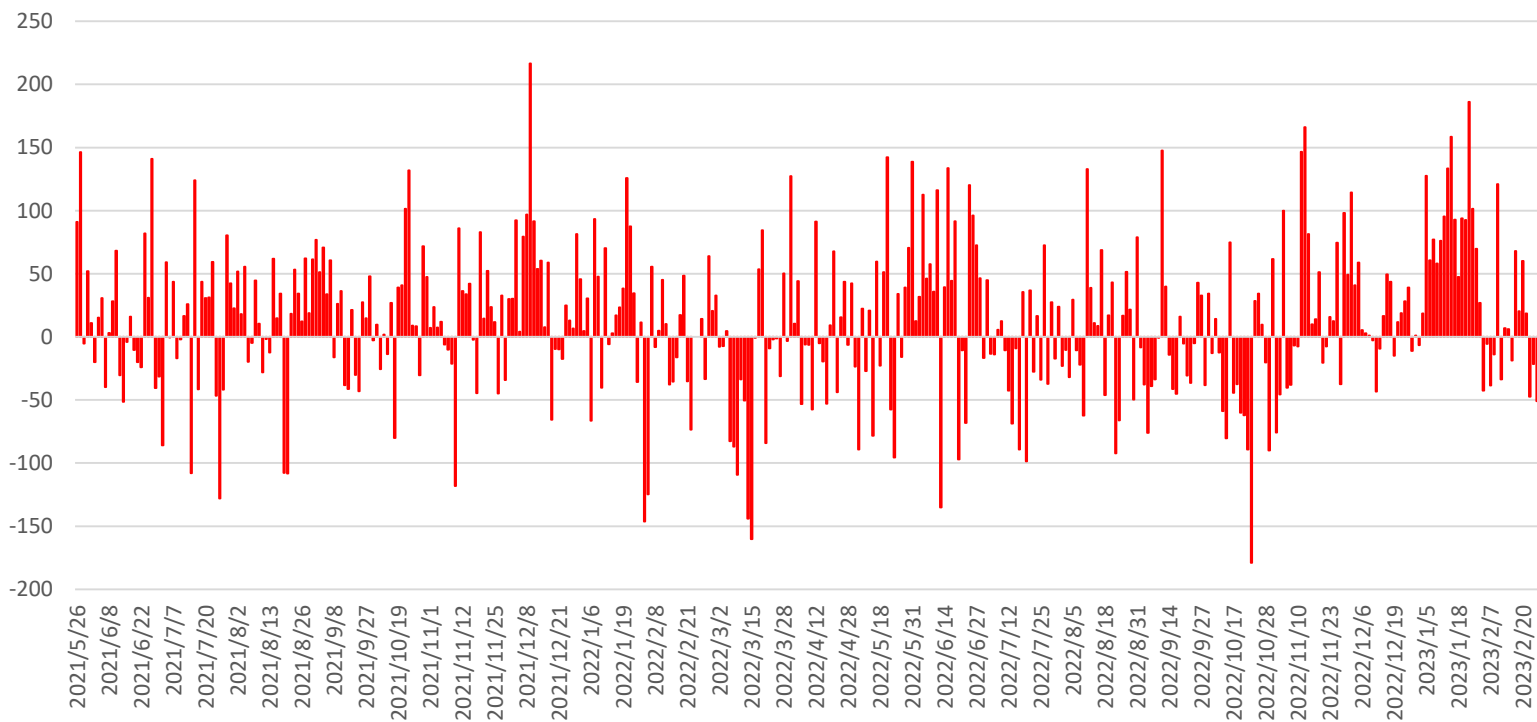


市场资金面-两融余额



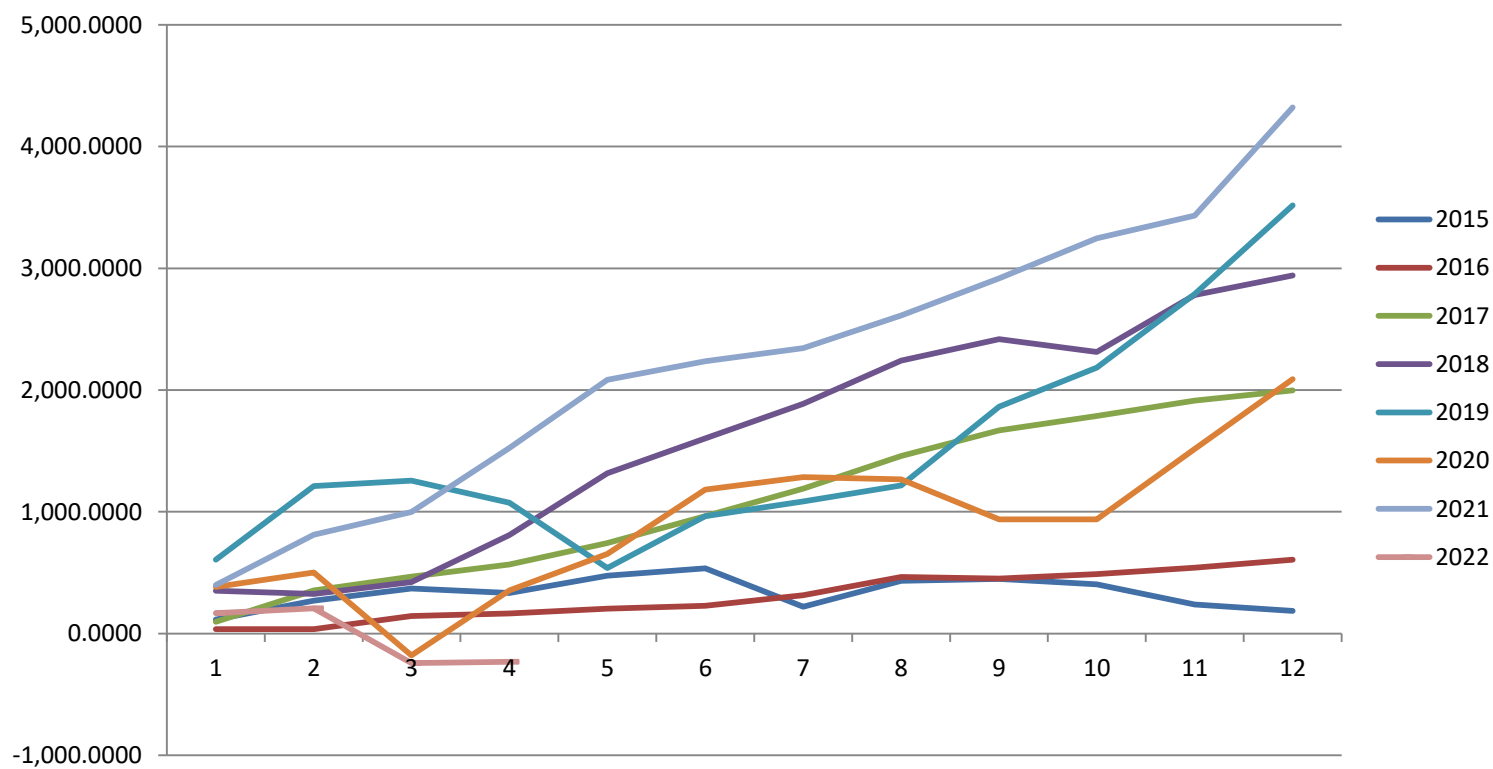
市场资金面-沪深股通

沪深股通净流入



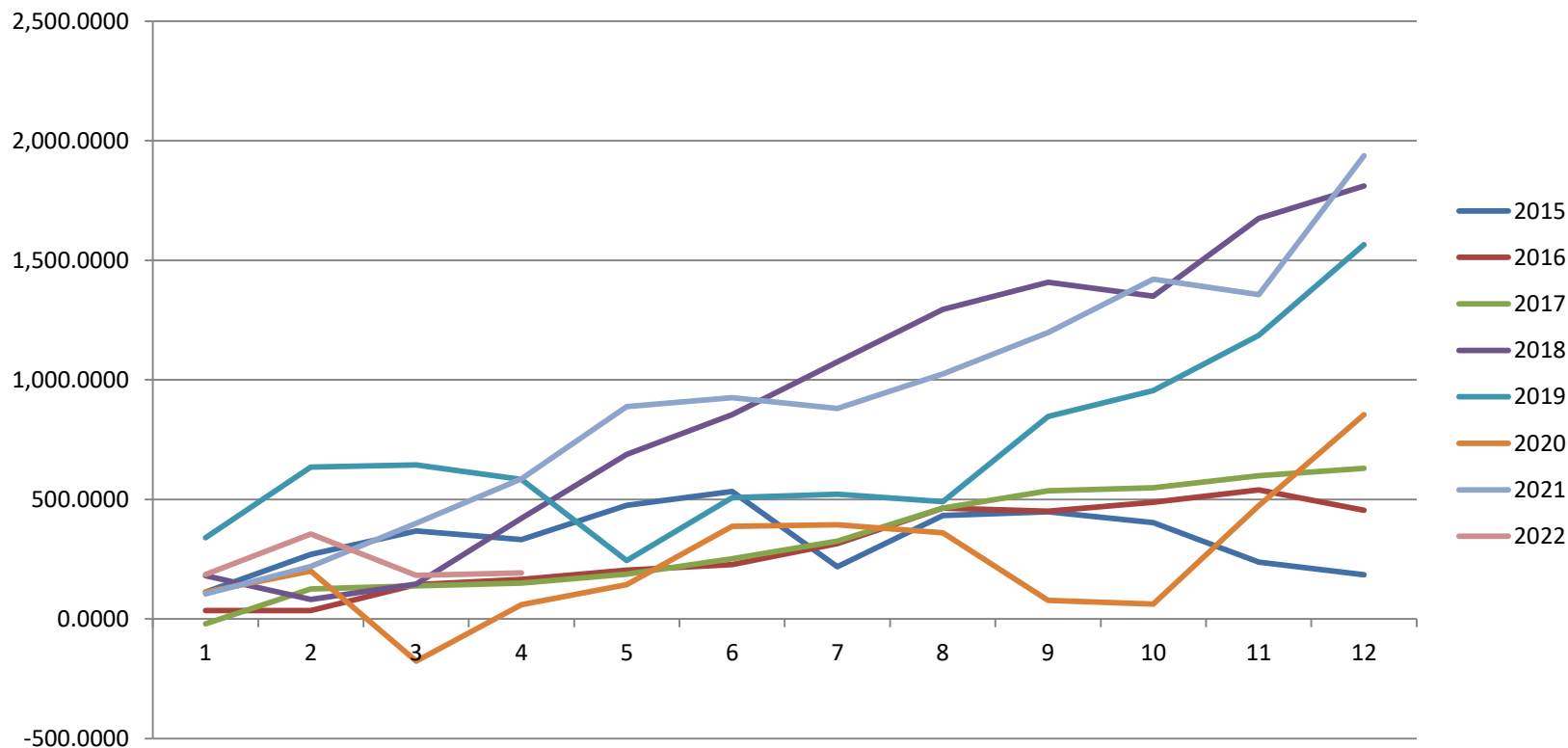
成交净流入-北向合计

北向合计(亿元,人民币) 成交净买入



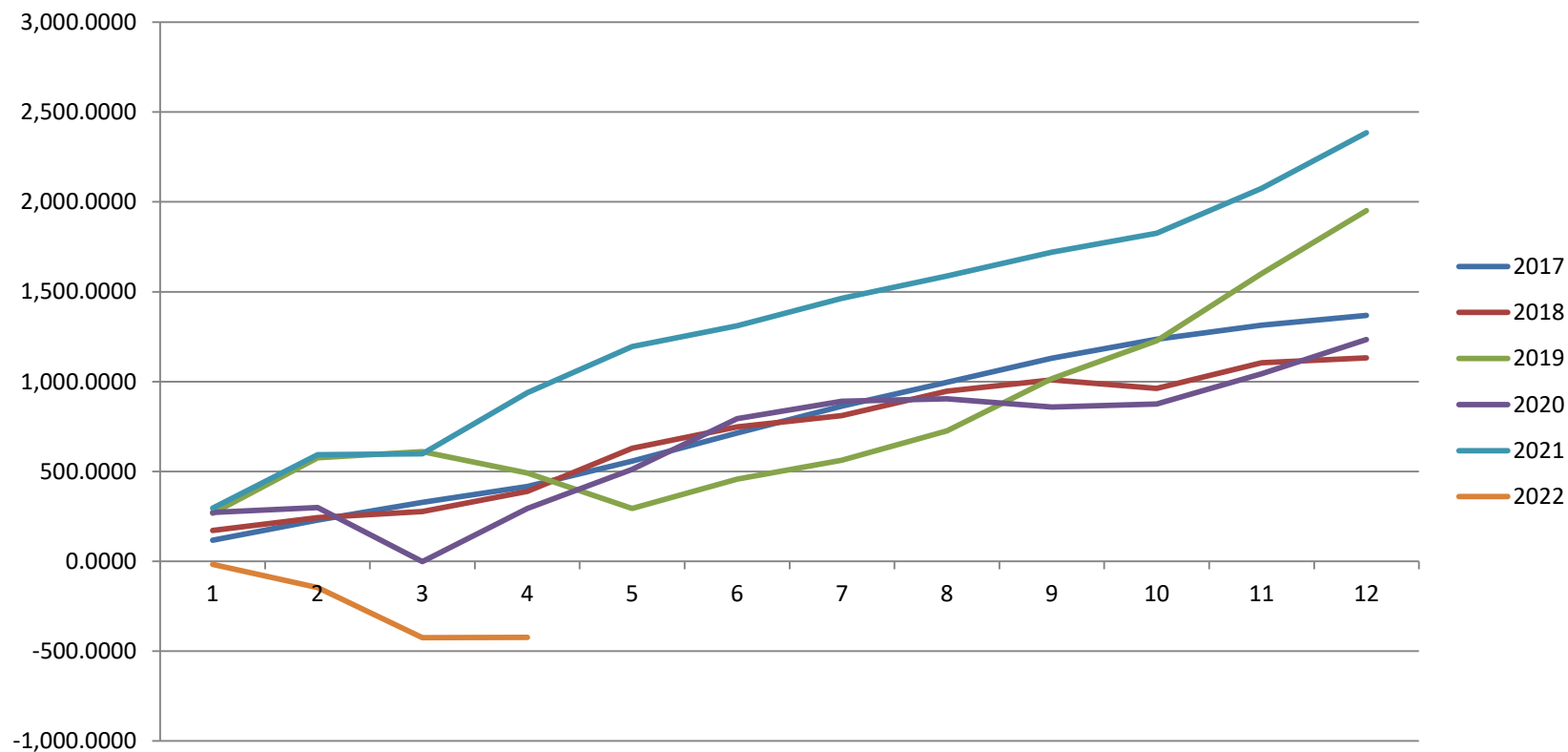
成交净流入-沪股通

沪股通(亿元,人民币) 成交净买入

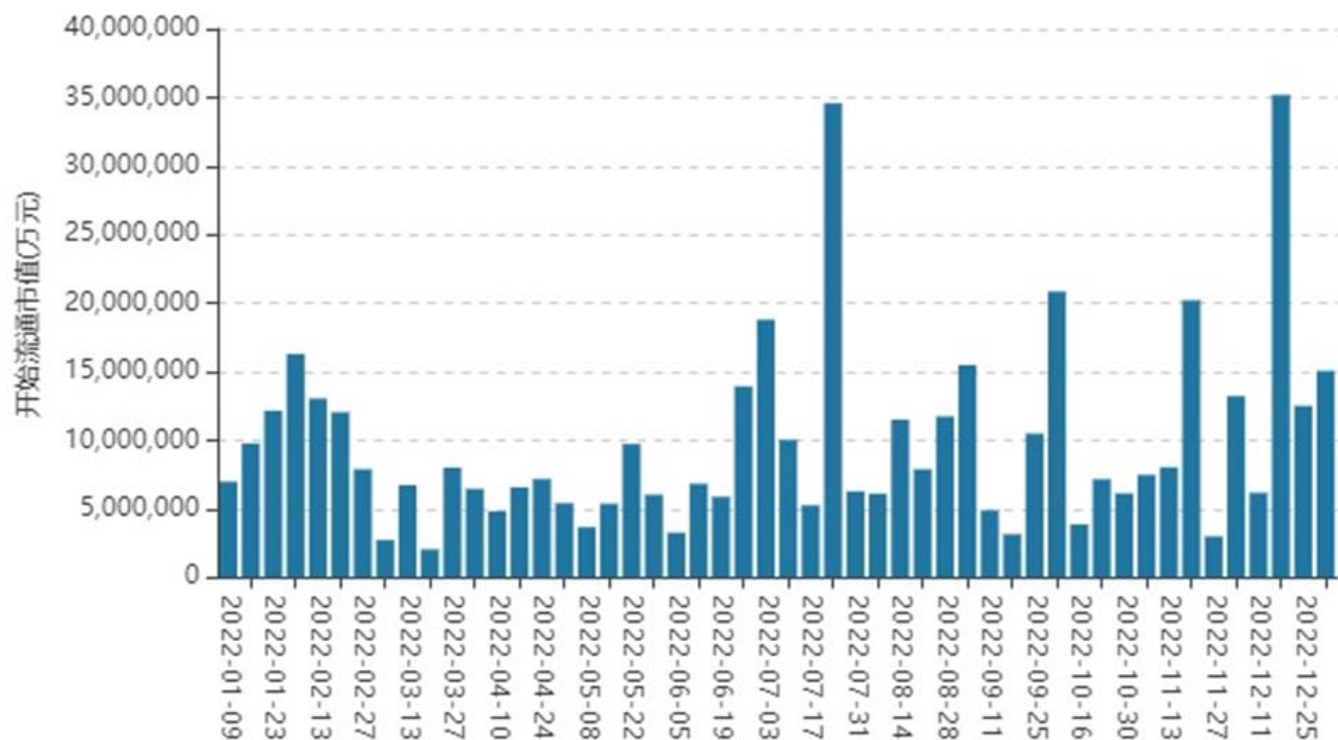


成交净买入-深股通

深股通(亿元,人民币) 成交净买入

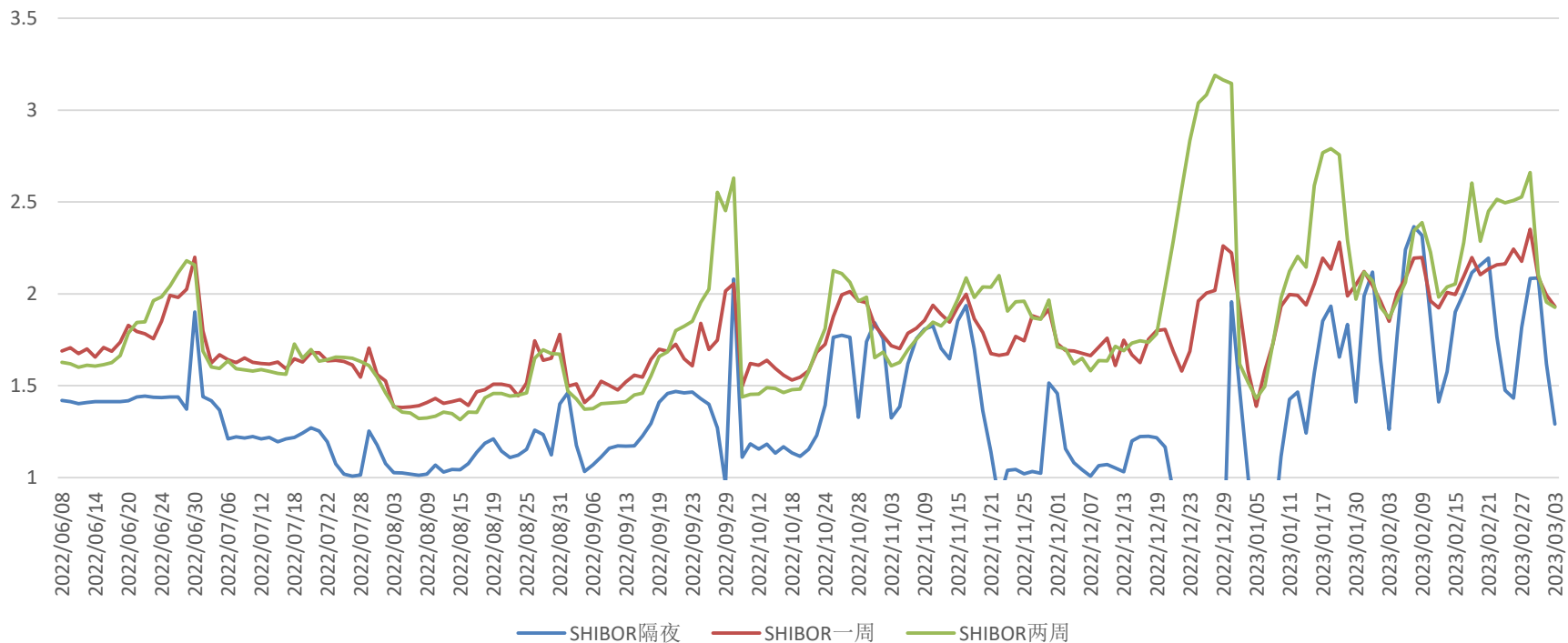


市场资金面-解禁



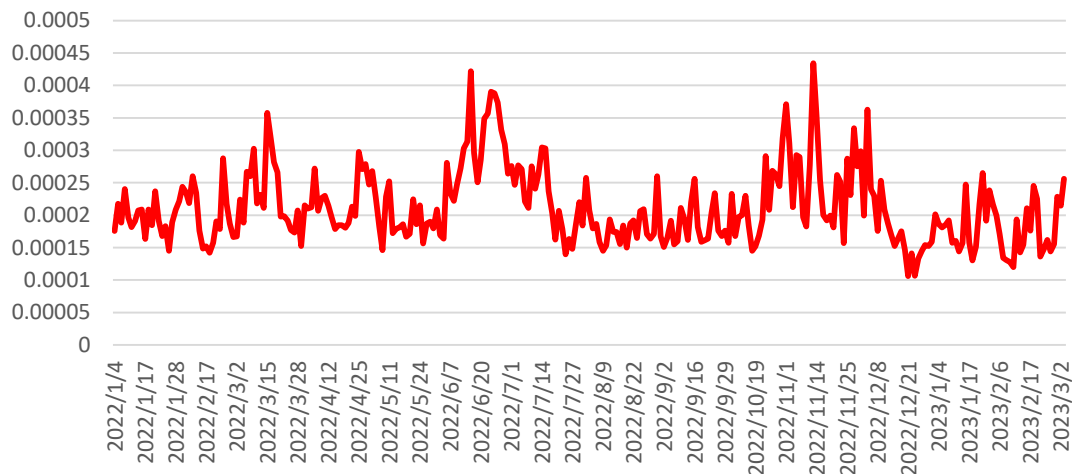
数据来源: Wind

市场资金面-资金成本

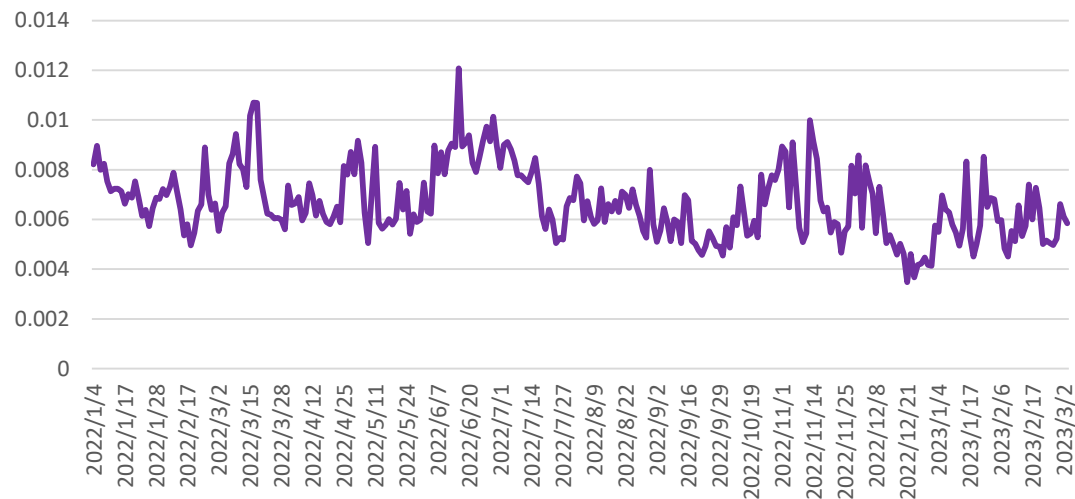


市场情绪-成交活跃度

上证50换手率（自由流通市值）

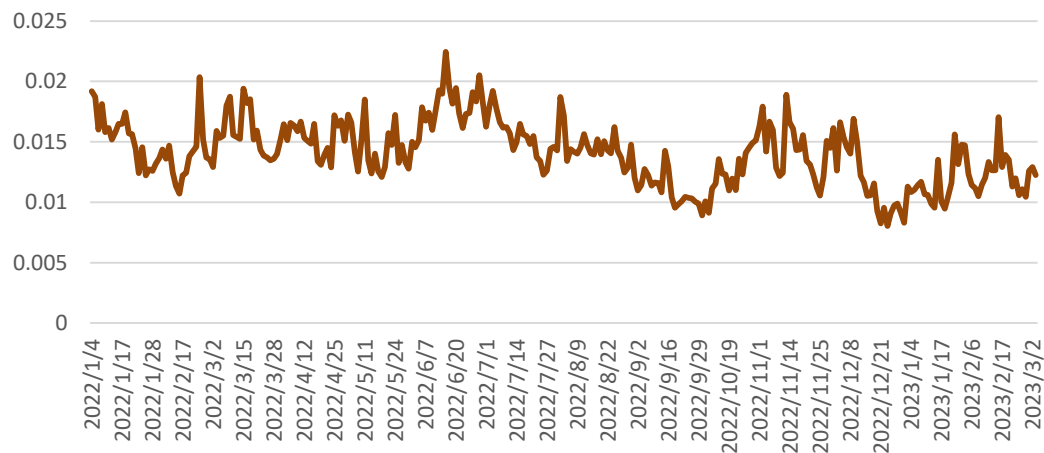


沪深300换手率（自由流通市值）

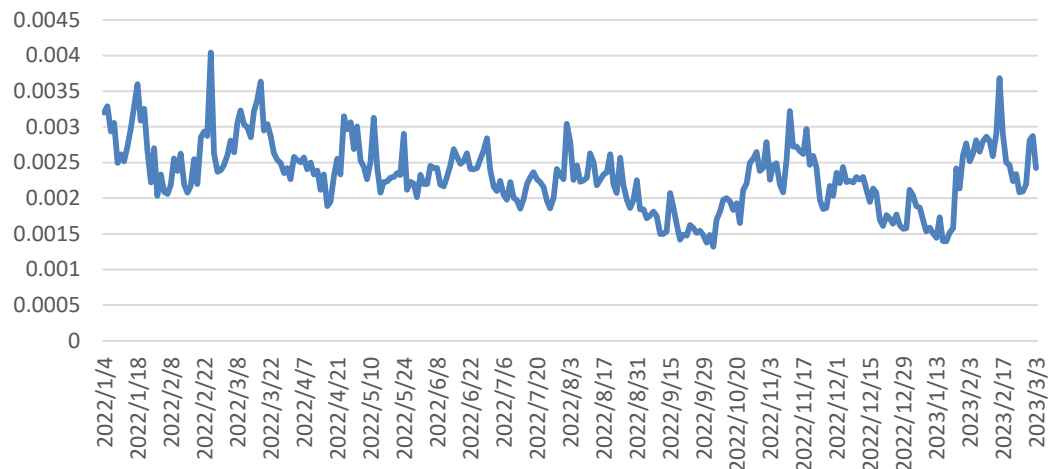


市场情绪-成交活跃度

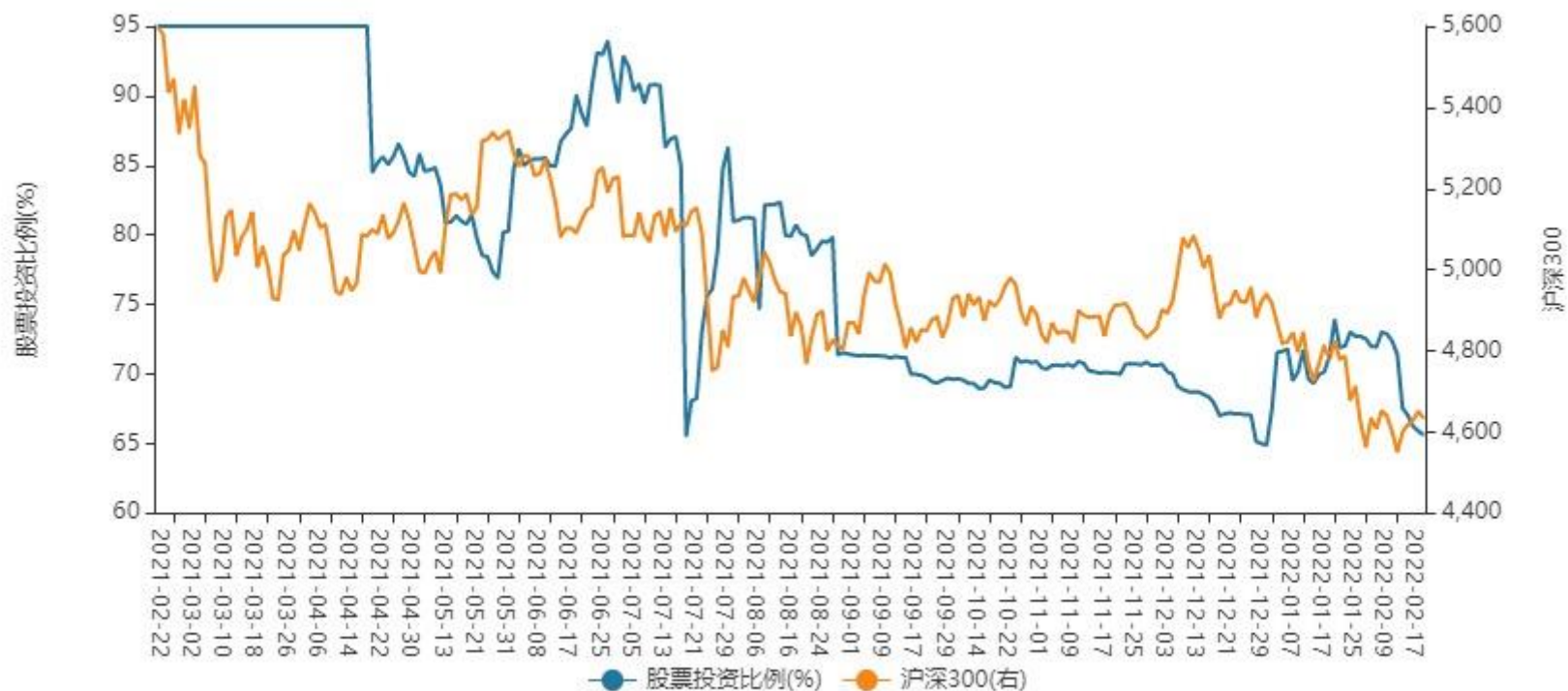
中证500换手率（自由流通市值）



创业板换手率（自由流通市值）

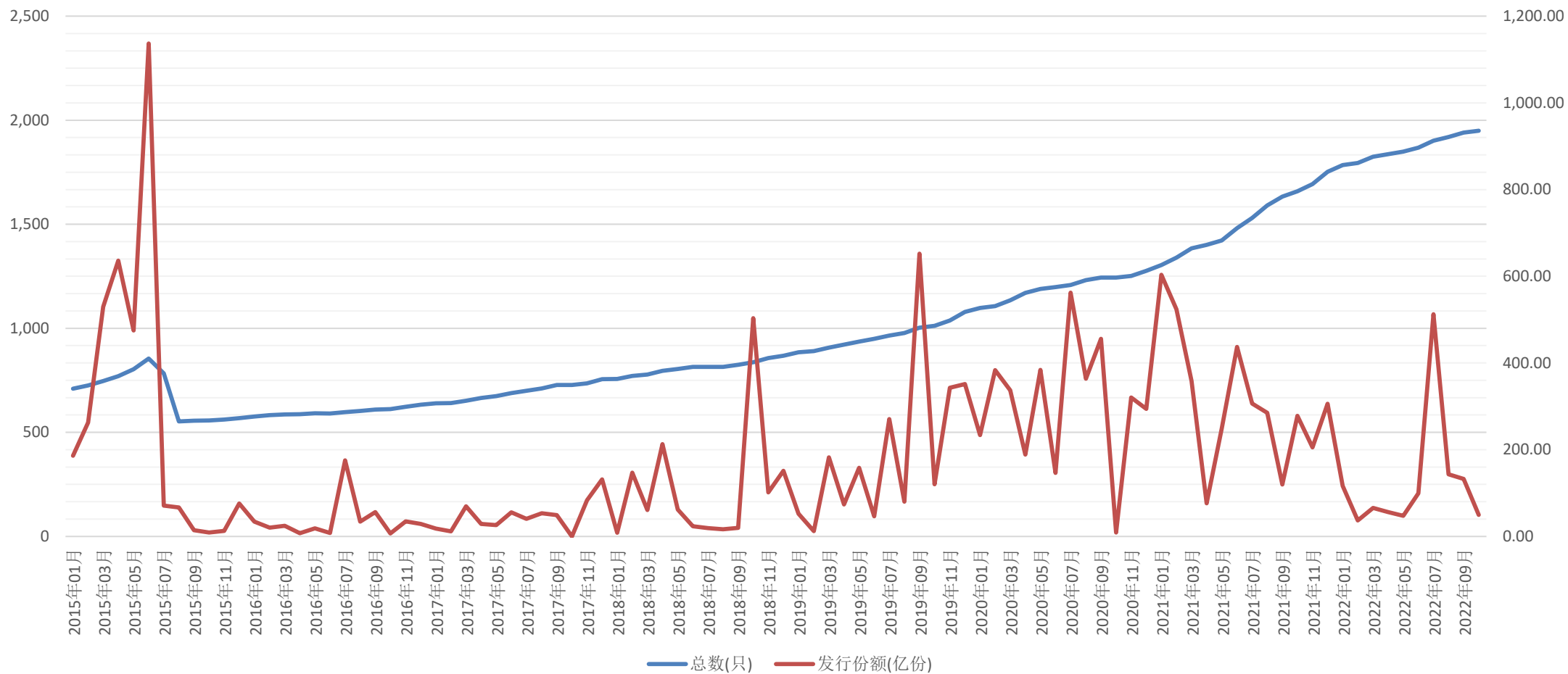


市场情绪-公募混合型基金仓位

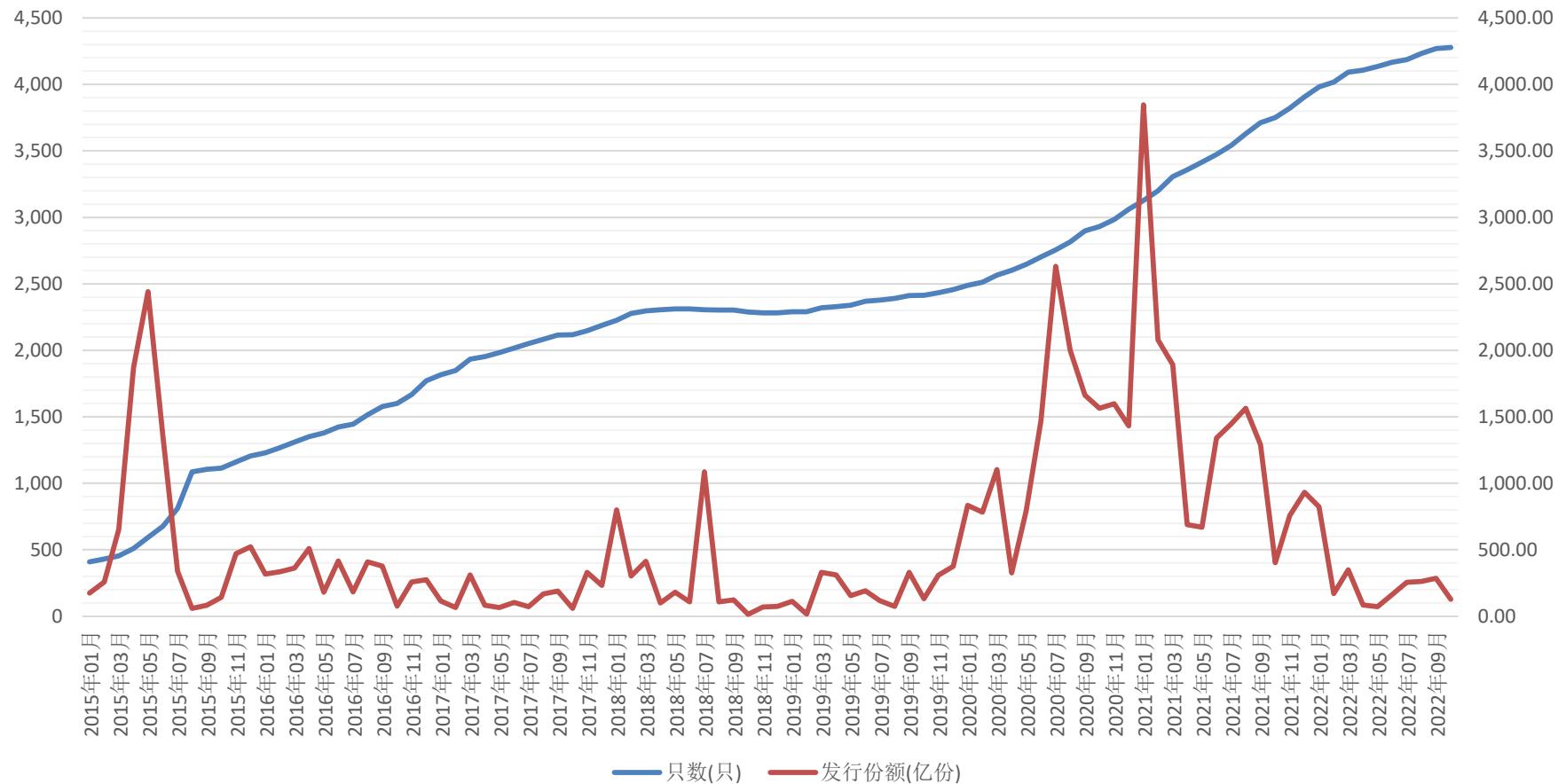


数据来源: Wind

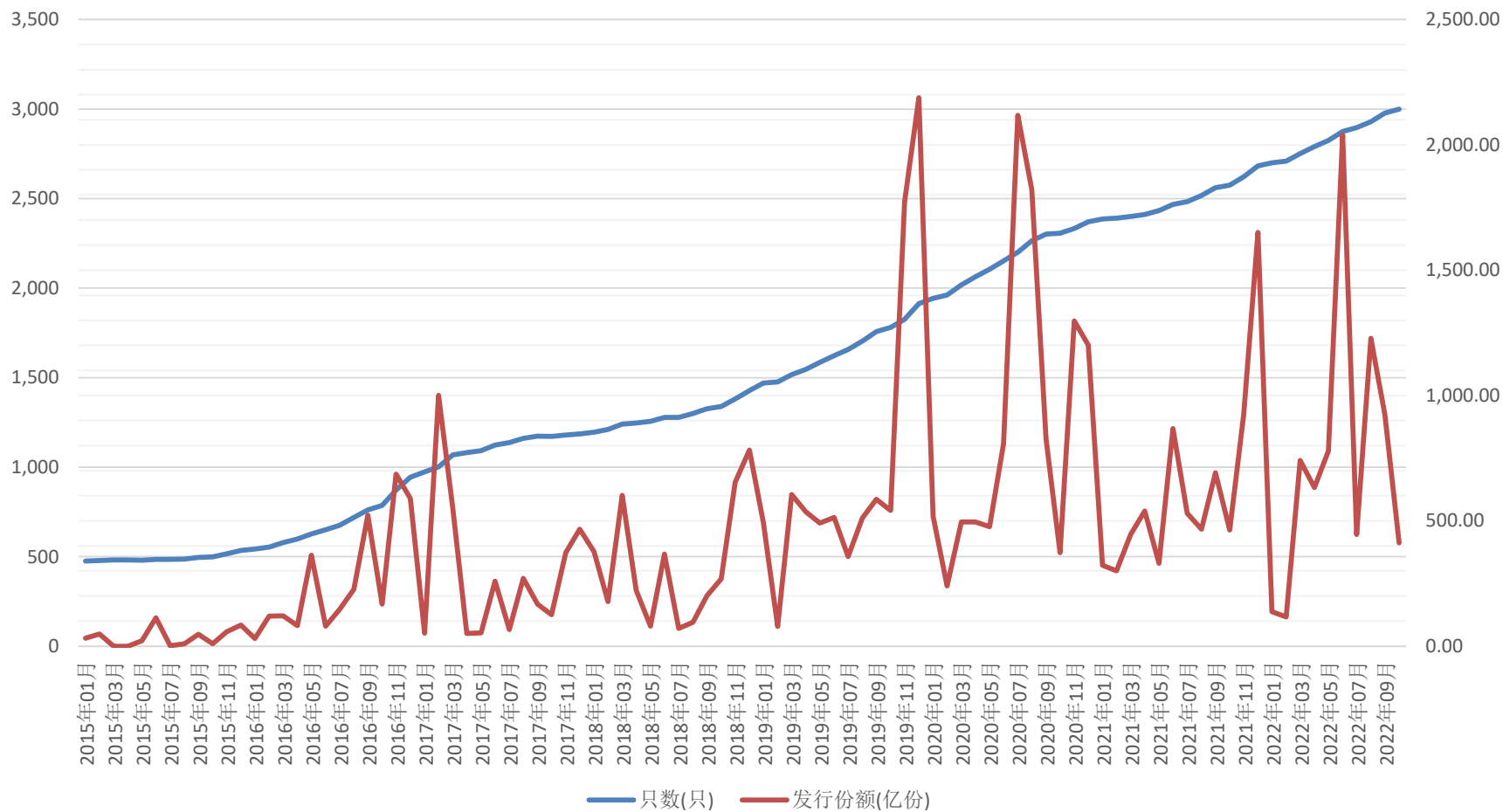
股票型基金月度成立数据图表



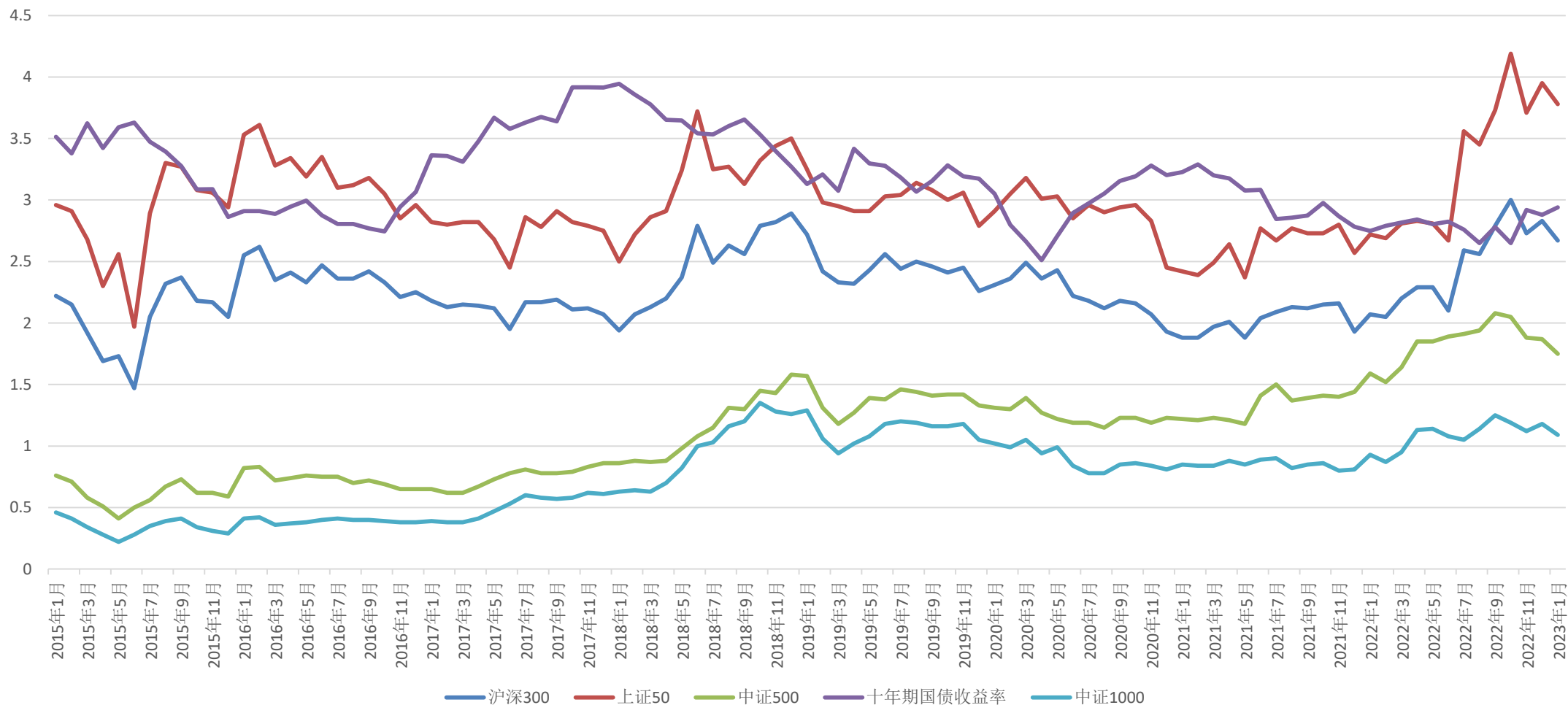
混合型基金月度成立数据图表



债券型基金月度成立数据图表



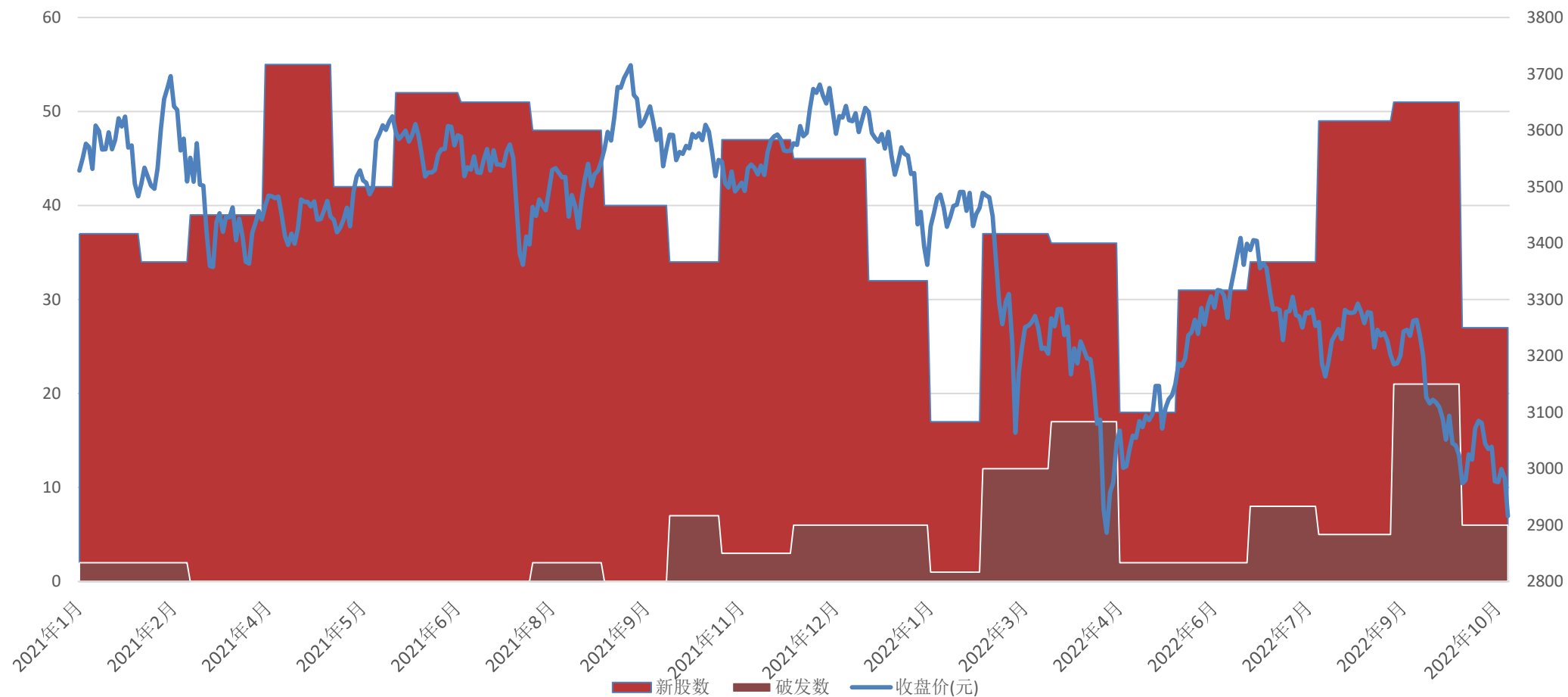
期指股息率与十年期国债收益率



新增开户数与上证综指走势跟踪

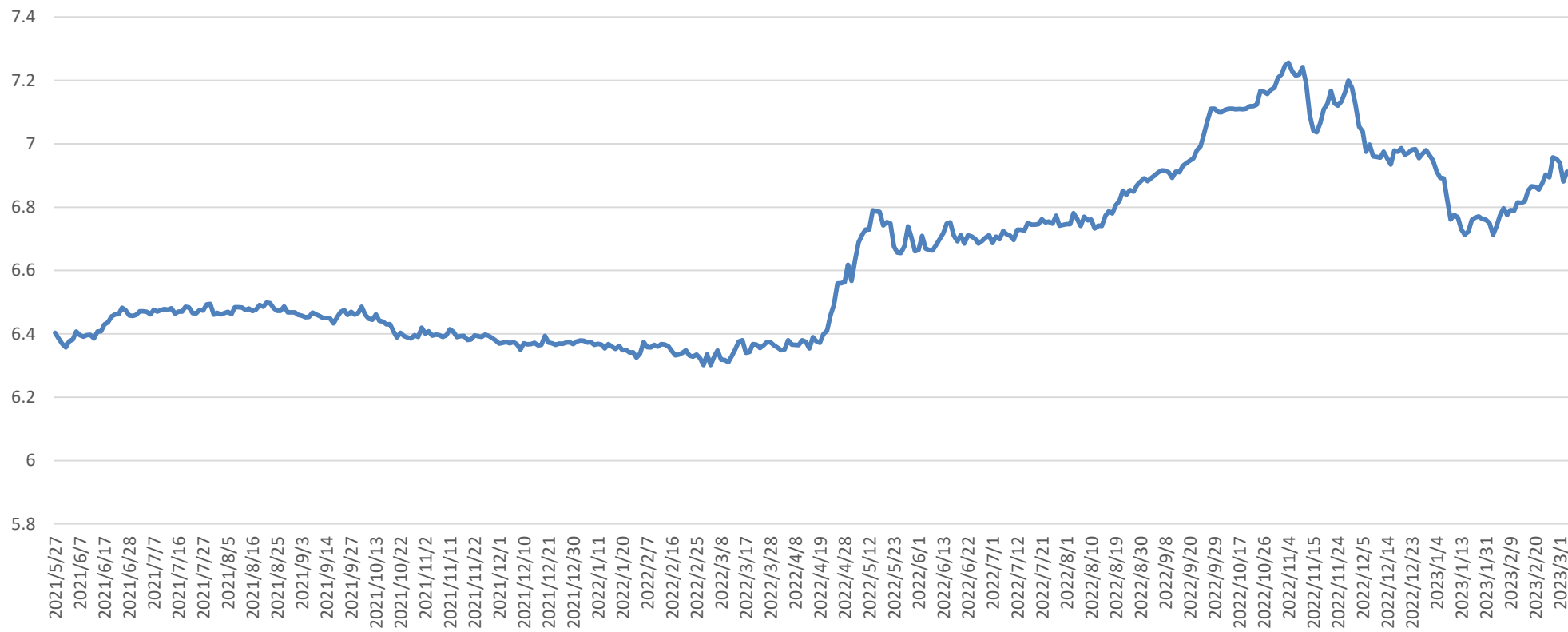


新股破发与上证指数跟踪



人民币汇率

美元兑人民币汇率



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。也不保证我公司所作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，如与大越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大越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、意见及推测只反映大越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。未经公司允许，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“大越期货股份有限公司”，并保留我公司的一切权利。

THANKS!

