

上海通联期货研究发展中心

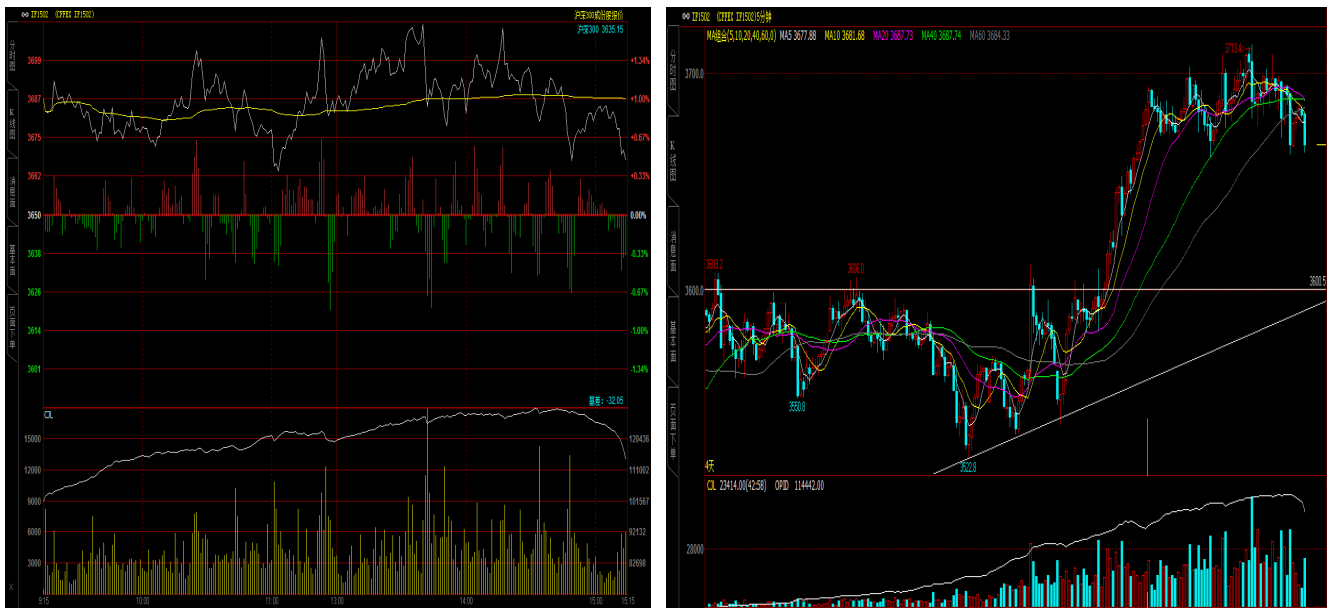
联系人:傅文浩

联系方式:(021)68866345*135

邮箱地址:fuwenhao23@126.com

股指期货日评

一、股指期货指数走势



今天股指期货主力1502合约开盘于3686.8点,开盘之后指数基本呈现横盘震荡,盘中期指多次上探3700均无功而返,两点以后指数小幅跳水,最终报收于3667.2点,较前一交易日上涨17点,涨幅0.47%。现货300指数走势略强于股指期货,最终报收于3635.15点,较前一交易日上涨31.03点,涨幅0.86%。从日K线来看整体均线呈现多头排列,今天指数基本确认十日均线支撑,短期下方支撑较为明显,唯一美中不足的是今天期指在创出新高之后收盘价低于昨天收盘价,而且连续上冲3700整数关口未果之后,多头信心有所打击。五分钟K线方面期指今天基本呈现3660-3700的区间震荡,但似乎短期有一定头肩顶的形态,因此如果指数未能站上3700反而下破3660的话,多头需要谨防40点左右的下跌风险。

合约简称	收盘价	涨跌	涨跌幅	成交量	持仓量
------	-----	----	-----	-----	-----

沪深300	3,635.15	31.03	0.86	28268161400	
期指1502合约	3667.2	17.0	0.47	1188668	114442

二、各行业表现

行业	涨跌幅(%)	收盘指数
计算机(申万)	4.7100	3,878.1900
传媒(申万)	4.2800	1,131.6400
农林牧渔(申万)	1.8400	2,318.0500
电气设备(申万)	1.8200	4,701.8900
机械设备(申万)	1.8100	1,398.0000
交通运输(申万)	0.4700	2,701.1900
建筑材料(申万)	0.3500	4,414.9600
房地产(申万)	-0.0100	4,048.1300
家用电器(申万)	-0.0100	3,992.1400
非银金融(申万)	-0.5100	2,378.5200

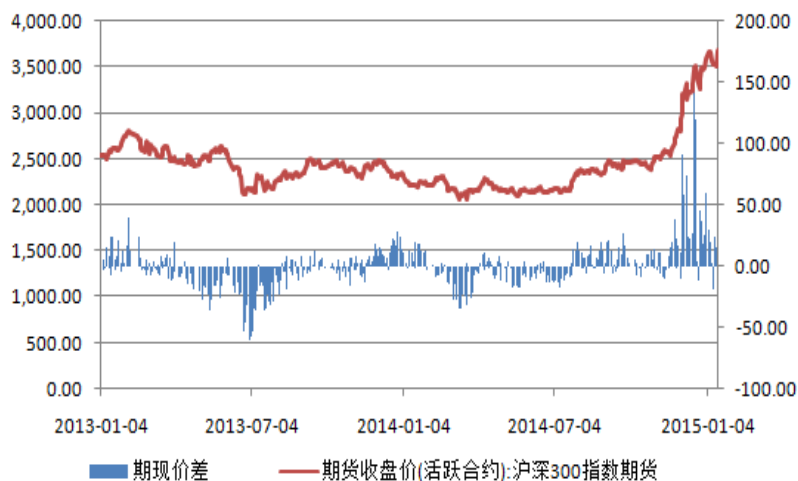
表:申万行业指数涨跌前五名

今天市场呈现“普涨”局面，计算机板块在昨天调整之后再度发力，今天以4.71的涨幅领涨各个行业，同时传媒、农林牧渔和电气设备也位列涨幅榜前列。跌幅榜方面非银行

金融领涨 家用电器和房地产位列

三、股指期货期现价差

	期货价格	现货价格	前一交易日价差	今日期现价差	较前一交易日变化
IF1502	3667.2	3635.15	-79.48	-32.05	47.43



1501合约今日交割，1502合约截止到今日收盘升水现货300指数32.05点，较前一交易日收窄47.43点，根据20点左右的期现套利点来测算，短期期指仍有回调修复价差的需求。

四、结论

今天期指主力1502合约呈现高位震荡格局，指数未能延续昨天强势上攻态势，3700整数关口久攻不破，上方压力较为明显。从宏观面来看央行放水市场意图较为明细，但市场成交量放大依然较为有限，这也是指数难以继续上行的主要因素。从技术来看五分钟均线在3700点似乎形成短期头肩顶的形态，如果周一指数未能站稳3660一线，短期指数仍有回踩五日均线的需求。周一随着打新资金逐步回流，市场或在短期进行方向选择，建议投资者可等待方向出来之后再进行操作。

免责声明：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。本报告版权归通联期货研究发展中心所有。未获得通联期货研究发展中心书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“通联期货发展研究中心”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。