

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1501合约开盘于3567点,开盘之后指数基本呈现窄幅震荡走势,上午收盘前受到银行、券商等权重板块杀跌,指数直接击穿3500整数关口,午后指数依托20日均线收复失地并再度回到上午震荡区间,最终股指期货报收于3537.6点,较前一交易日下跌58.6点,跌幅1.63%。现货300指数报收于3513.58点,下跌33.14点,跌幅0.93%。从日K线来看,今天指数呈现长下影线的小阴线,指数在20日均线获得支撑,但是五日均线下穿十日均线形成死叉,短期上方压力和下方支撑都较为明显,震荡仍是行情的主旋律。五分钟K线来看期指在3460一线形成双底,价格尾盘的大幅反弹明显但仍未能突破前期上方区间,明天继续关注3550一线压力。

合约简称	收盘价	涨跌	涨跌幅	成交量	持仓量
沪深300	3,513.58	-33.14	-0.93	26656717500	3,513.58
期指1501合约	3537.6	-58.6	-1.63	1268691	81457

二、各行业表现

行业	涨跌幅(%)	收盘指数
计算机(申万)	2.2600	3,625.0200
传媒(申万)	1.5300	1,072.2800
家用电器(申万)	1.5100	3,914.4700
汽车(申万)	1.1200	4,227.3600
休闲服务(申万)	0.0700	4,096.3000
机械设备(申万)	-2.7400	1,335.8600
钢铁(申万)	-3.0400	2,636.5300
采掘(申万)	-3.1400	3,693.4000
国防军工(申万)	-3.3500	1,436.0700
建筑装饰(申万)	-3.5200	2,634.1300

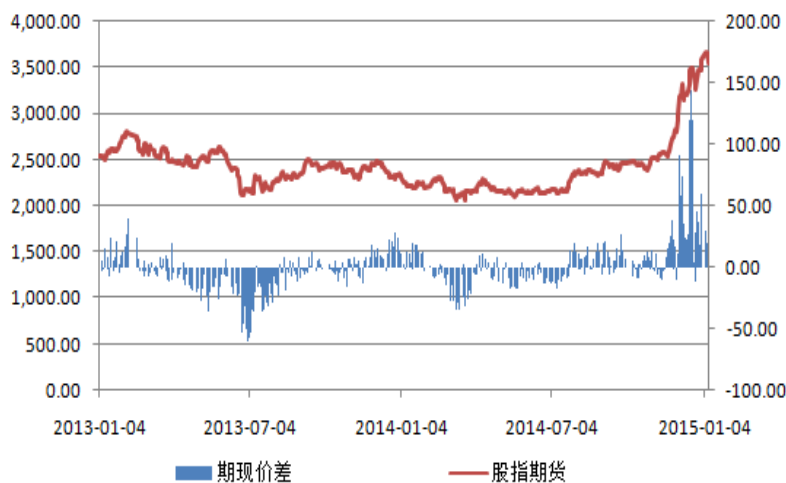
表: 申万行业指数涨跌前五名

从各个板块来看, 计算机继续领涨申万300各个板块, 同时传媒、家用电器涨幅也位居前三。跌幅方面, 建筑、军工和采掘业位居前三, 同时钢铁及机械等一些权重板块

通联期货研究发展中心

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
IF1501	3537.4	3513.58	18.72	-24.02	-42.75



期现价差在今天出现了明显的转变, 截止到收盘, 股指期货升水现货300指数24.02点, 较前一交易日扩大42.75点, 期货指数强于现货, 但如果现货300未能有效跟涨, 短期期货的强势也较难延续。

四、结论

证监会宣布2月9日上市50ETF期权，金融改革再度加速。从期权角度来看，50ETF的上市对于权重股而言无疑再获利好，权重股的价值投资将被重视，而且投资策略的增加也会对整体股市产生中期利好。今天期指高开就是对这一利好的兑现，但是之后随着权重股的下跌，指数重回跌势是一种短期资金紧张的反应，毕竟本周22只新股IPO资金压力较大，在政策真空期的当下，流动性的下降势必将对价格产生影响，因此我们认为短期指数仍有一定调整，弱势震荡仍是主旋律，上下区间分别为，上方关注3550一线，下方仍以今日双底3460一线作为支撑。

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。