

撰写人: 张昕 从业资格号: F3073677 投资咨询从业证书号: Z0015602

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货盘面	IF主力合约 (2206)	4183.2	-51.0↓	IF次主力合约 (2206)	4146.8	-52.4↓
	IH主力合约 (2206)	2839.2	-53.6↓	IH次主力合约 (2206)	2805.2	-51.6↓
	IC主力合约 (2206)	6217.8	-24.8↓	IC次主力合约 (2206)	6166.6	-25.8↓
	IF-IH当月合约价差	1344.0	+1.6↑	IC-IF当月合约价差	2034.6	+18.2↑
				IC-IH当月合约价差	3378.6	+19.8↑
	IF当季-当月	-68.0	-5.2↓	IF下季-当月	-93.6	-15.6↓
	IH当季-当月	-47.2	-1.4↓	IH下季-当月	-43.2	+2.2↑
IC当季-当月	-135.6	-0.2↓	IC下季-当月	-247.4	-1.0↓	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-18763	+3197.0↑	IH前20名净持仓	-19,762	+913.0↑
	IC前20名净持仓	-21282	-1966.0↓			
现货价格	沪深300	4189.35	-49.6↓	IF主力合约基差	-6.2	-50.8↓
	上证50	2844.72	-54.9↓	IH主力合约基差	-5.5	-52.4↓
	中证500	6233.62	-6.5↓	IC主力合约基差	-15.8	-32.6↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)		+10503.19↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,332.88	+5.13↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+116.22	-135.19↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+100
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+218.20	-387.91↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	50.01	-32.96↓	Shibor (日, %)	1.408	+0.00↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2206)	33.60	-33.60↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.87	+0.68↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2206)	53.20	+22.20↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.63	+2.16↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.56	+0.75↑	成交量PCR (%)	99.17	-0.61↓
Wind市场强弱分析	全部A股	4.70	-3.30↓	技术面	5.00	-3.20↓
	资金面	4.40	-3.26↓			
行业消息	<p>1., 6月13日, 中汽协公布数据显示, 受利好因素影响, 5月汽车产销呈现明显恢复性增长。国内多点散发的新冠肺炎疫情得到有效控制, 经济景气水平较4月份有所改善。5月下旬以来, 党中央陆续出台了一系列促消费、稳增长的政策措施, 政策包容性强, 对于推动经济回归正常轨道, 确保运行在合理区间, 起到了良好的效果。同时地方政府积极响应, 出台多种促进汽车消费的配套政策, 极大地活跃了市场。此外, 通过汽车行业上下努力拼搏, 复工复产节奏显著加快, 汽车产业链供应链逐步畅通。</p>					<p>更多观点请咨询!</p>
观点总结	<p>A股主要指数集体回调。沪指早盘呈弱下行, 收跌接近1%。创业板指全天于平盘附近宽幅震荡。三期指均收跌, 其中沪深300以及上证50显著回调, 中证500则支撑较强。北向资金大幅净流出。当前板块间热点轮动仍然较快, 资金多空分歧较强, 短期股指延续涨势取决于市场量能能否大幅提升。预计本周指数于3300点压力位前存在调整倾向, 需密集关注政策面、资金面以及外部环境因素的变化。资产配置层面, 关注稳增长主线、疫后修复主线以及中报业绩较好板块。技术面上, 指数短线蓄势反弹, 结合低估值以及疫情修复逻辑, 在稳增长政策发力下, 建议轻仓介入多IC合约。</p>					<p>更多资讯请关注!</p>
重点关注	<p>6-14 20: 30 美国5月核心PPI同比; 美国5月PPI同比; 美国5月核心PPI环比; 美国5月PPI环比 6-15 10: 00 中国1至5月全国房地产开发投资; 中国1至5月城镇固定资产投资同比; 中国1至5月社会消费品零售总额同比; 中国5月社会消费品零售总额同比; 中国1至5月规模以上工业增加值同比; 中国5月规模以上工业增加值同比 6-16 20: 30 美国6月11日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国5月新屋开工(万户); 美国5月营建许可(万户)</p>					

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!

备注: IF:沪深300 IH:上证50 IC:中证500 IO:沪深300期权