

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) | 4152.4 | +13.0↑ | IF次主力合约 (2206) | 4121.6 | +16.2↑ |
| | IH主力合约 (2206) | 2835.4 | +24.6↑ | IH次主力合约 (2206) | 2799.6 | +24.4↑ |
| | IC主力合约 (2206) | 6148.0 | -12.4↓ | IC次主力合约 (2206) | 6097.0 | -12.8↓ |
| | IF-IH当月合约价差 | 1317.0 | -13.4↓ | IC-IF当月合约价差 | 1995.6 | -17.8↓ |
| | | | | IC-IH当月合约价差 | 3312.6 | -31.2↓ |
| | IF当季-当月 | -62.8 | -0.2↓ | IF下季-当月 | -80.4 | +0.4↑ |
| | IH当季-当月 | -44.6 | +0.8↑ | IH下季-当月 | -46.4 | +2.6↑ |
| | IC当季-当月 | -142.2 | -4.4↓ | IC下季-当月 | -258 | -11.2↓ |
| 期货持仓头寸 (净多) | IF前20名净持仓 | -22510 | +1626.0↑ | IH前20名净持仓 | -18,171 | -199.0↓ |
| | IC前20名净持仓 | -23591 | +429.0↑ | | | |
| 现货价格 | 沪深300 | 4179.13 | +13.0↑ | IF主力合约基差 | -26.7 | +8.0↑ |
| | 上证50 | 2846.81 | +21.2↑ | IH主力合约基差 | -11.4 | +21.4↑ |
| | 中证500 | 6186.57 | -0.9↓ | IC主力合约基差 | -38.6 | -9.8↓ |
| Wind市场强弱分析 | A股成交额 (日, 亿元) | 10,387.85 | -735.44↓ | 两融余额 (前一交易日, 亿元) | 15,244.81 | +101.17↑ |
| | 陆股通 (昨日, 今日, 亿元) | +31.83 | +31.83 | 逆回购 (到期量, 操作量, 亿元) | -100 | +100 |
| | 主力资金 (昨日, 今日, 亿元) | -49.35 | +46.07 | MLF (续作量, 净投放, 亿元) | | |
| | 上涨股票比例 (日, %) | 32.65 | -45.54↓ | Shibor (日, %) | 1.421 | -0.03↓ |
| 沪深300指数期权 | IO平值看涨期权收盘价 (2206) | 41.00 | +4.40↑ | IO平值看涨期权隐含波动率 (%) | 20.17 | +6.40↑ |
| | IO平值看跌期权收盘价 (2206) | 88.60 | -5.20↓ | IO平值看跌期权隐含波动率 (%) | 20.72 | +9.42↑ |
| | 沪深300指数20日波动率 (%) | 16.27 | -0.53↓ | 成交量PCR (%) | 75.36 | -15.93↓ |
| Wind市场强弱分析 | 全部A股 | 4.30 | -3.50↓ | 技术面 | 3.30 | -4.50↓ |
| | 资金面 | 5.40 | -2.30↓ | | | |
| 行业消息 | 1.5月财新中国制造业采购经理人指数 (PMI) 录得48.1, 高于4月2.1个百分点, 与3月持平, 同为2020年3月以来次低; 财新中国服务业PMI回升5.2个百分点至41.4。两个行业PMI均有回升, 带动5月财新中国综合PMI录得42.2, 高于4月5个百分点, 显示近期疫情形势好转带动经济景气度回升, 但疫情约束仍然明显。 | | | | |  |
| 观点总结 | A股主要指数走势分化。沪指全天震荡整理为主, 创业板指尾盘收平。三期指中, 上证50以及沪深300走势较强, 中证500尾盘跌幅收窄至平盘下方。5月份官方PMI显示整体经济景气度小幅回升, 全国疫情形势好转, 复工复产逐步推进, 物流运输边际改善, 供需呈现“双回暖”。短线来看, 当前市场呈现较好上升趋势, 国内疫情修复逻辑是主要利好因素, 市场预期亦显著改善。然而市场仍需进一步确认稳增长加码下基本面数据的“持续性”向好, 因而预期或仍存在一定波动性, 需静待基本面拐点预期来临支撑反转动能。展望六月份, 疫情复苏以及政策发力下, 对行情的看法相对乐观。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>更多观点请咨询!</p>  <p>更多资讯请关注!</p> |
| 重点关注 | 6-7 20: 30 美国4月贸易帐(亿美元) 6-9 待定 中国5月M2货币供应同比; 中国5月M1货币供应同比; 中国5月M0货币供应同比; 中国5月新增人民币贷款(亿人民币); 中国5月社会融资规模增量(亿人民币); 中国5月贸易帐(按人民币计)(亿人民币); 中国5月进口同比(按人民币计); 中国5月出口同比(按人民币计); 中国5月进口同比(按美元计); 中国5月出口同比(按美元计); 20: 30 美国6月4日当周首次申请失业救济人数(万人) 6-10 09: 30 中国5月CPI同比; 中国5月PPI同比; 20: 30 美国5月核心CPI同比; 美国5月CPI同比; 22: 00 美国6月密歇根大学消费者信心指数初值 | | | | | |

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