

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)	4168.0	-23.4↓	IF次主力合约 (2206)	4133.0	-22.6↓
	IH主力合约 (2206)	2860.0	-4.2↓	IH次主力合约 (2206)	2825.4	-1.4↓
	IC主力合约 (2206)	6119.8	-50.8↓	IC次主力合约 (2206)	6069.8	-46.0↓
	IF-IH当月合约价差	1308.0	-23.8↓	IC-IF当月合约价差	1951.8	-35.6↓
				IC-IH当月合约价差	3259.8	-59.4↓
	IF当季-当月	-65.4	+0.0↑	IF下季-当月	-80	+2.6↑
	IH当季-当月	-47.8	-1.4↓	IH下季-当月	-46.8	-1.6↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-26780	+633.0↑	IH前20名净持仓	-19,213	+1180.0↑
	IC前20名净持仓	-20272	-2292.0↓			
现货价格	沪深300	4175.67	-44.1↓	IF主力合约基差	-7.7	-34.6↓
	上证50	2868.42	-10.9↓	IH主力合约基差	-8.4	-10.8↓
	中证500	6130.69	-87.1↓	IC主力合约基差	-10.9	-70.2↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	9,766.70	-1244.05↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,320.94	+40.60↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+35.79	+57.67↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+100
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-180.59	-408.89↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	15	-20.43↓	Shibor (日, %)	1.414	-0.01↓
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2206)	36.80	-21.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.58	-4.09↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2206)	70.00	+11.20↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.91	-5.37↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.44	+0.23↑	成交量PCR (%)	95.17	+15.73↑
Wind市场强弱分析	全部A股	2.70	-2.50↓	持仓量PCR (%)	111.06	-5.98↓
	资金面	3.80	-3.00↓	技术面	1.50	-1.80↓
行业消息	1.海关总署: 今年前5个月, 我国进出口总值16.04万亿元人民币, 比去年同期 (下同) 增长8.3%。其中, 出口8.94万亿元, 增长11.4%; 进口7.1万亿元, 增长4.7%; 贸易顺差1.84万亿元, 扩大47.6%。按美元计价, 前5个月我国进出口总值2.51万亿美元, 增长10.3%。其中, 出口1.4万亿美元, 增长13.5%; 进口1.1万亿美元, 增长6.6%; 贸易顺差2904.6亿美元, 扩大50.8%。				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数集体回调。沪指结束七连阳涨势, 全天震荡下行。创业板指大幅调整, 收跌接近3%。三期指均收跌, 其中中证500显著回调超过1%。两市成交量有所下降。盘面上看, 汽车、半导体板块大幅下挫, 教育、软件、旅游、医药、食品饮料、酒类等板块均走弱; 石油、银行、煤炭、券商、保险等板块逆势拉升。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。六月份来看, 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>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	6-9 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