

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 (2609)	4796.4	+45.01	IF次主力合约 (2607)	4869.8	+44.61
	IH主力合约 (2609)	2928.0	+65.61	IH次主力合约 (2607)	2944.2	+62.01
	IC主力合约 (2609)	8537.6	+76.01	IC次主力合约 (2607)	8715.2	+85.01
	IM主力合约 (2609)	8308.6	-15.41	IM次主力合约 (2607)	8514.2	-25.61
	IF-IH当月合约价差	1925.6	-16.61	IC-IF当月合约价差	3845.4	+55.61
	IM-IC当月合约价差	-201.0	-118.01	IC-IH当月合约价差	5771.0	+39.01
	IM-IF当月合约价差	3644.4	-62.41	IM-IH当月合约价差	5570.0	-79.01
	IF当季-当月	-73.4	+4.21	IF下季-当月	-159.6	+1.01
	IH当季-当月	-16.2	+8.41	IH下季-当月	-46.6	+4.21
	IC当季-当月	-177.6	-9.01	IC下季-当月	-390.2	-19.41
IM当季-当月	-205.6	+7.81	IM下季-当月	-463.2	+3.41	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	27,731.00	-1803.01	IH前20名净持仓	21,320.00	+722.01
	IC前20名净持仓	21,545.00	-412.01	IM前20名净持仓	51,702.00	-271.01
现货价格	沪深300	4926.92	+58.71	IF主力合约基差	-130.5	-10.51
	上证50	2,991.1	+84.11	IH主力合约基差	-63.1	-15.11
	中证500	8,821.1	+117.51	IC主力合约基差	-283.5	-26.91
	中证1000	8,597.9	-3.51	IM主力合约基差	-289.3	-7.11
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	35,393.41	-360.501	两融余额 (前一交易日, 亿元)	30,119.61	-210.311
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	4131.41	-107.171	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-4765.0	+4575.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-1783.39	-495.341	MLF (到期量, 投放量, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	44.65	+30.371	Shibor (日, %)	1.356	-0.0151
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2607)	62.40	+7.401	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	20.71	-1.161
	IO平值看跌期权收盘价 (2607)	141.00	-41.001	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	20.23	-2.041
	沪深300指数20日波动率 (%)	25.69	+0.311	成交量PCR (%)	69.62	-8.941
				持仓量PCR (%)	74.22	+3.151
行业消息	<p>1、国家统计局公布数据显示, 1—5月份, 全国规模以上工业企业实现利润总额31439.6亿元, 同比增长18.8%, 较1—4月份加快0.6个百分点。1—5月份, 电子行业利润增长103.9%, 对全部规模以上工业企业利润增长的贡献率达43.1%。</p>  <p>更多观点请咨询!</p>					
观点总结	<p>A股主要指数收盘多数上涨, 三大指数表现分化, 沪市明显强于深市。截止收盘, 上证指数涨1.16%, 深证成指涨0.19%, 创业板指涨0.54%。沪深两市成交额小幅回落。行业板块涨跌互现, 医药生物板块大幅拉升, 综合、建筑材料板块明显走弱。海外方面, 美股存储芯片巨头美光科技最新一季财报营收、毛利率、净利、EPS均超市场预期, 营收同比大幅增长超三倍, 同时美光大幅上调第四财季财测。然而受到存储及内存芯片成本持续上升, 微软和苹果相继上调产品价格, 增加市场对芯片成本高企的担忧。国内方面, 经济基本面, 1—5月份, 全国规模以上工业企业实现利润总额同比增速较1—4月份进一步加快。其中, 规模以上高技术制造业拉动全部规模以上工业企业利润增长8.0个百分点。此前公布的经济数据中高技术类产品与高技术制造业同样出口与规上工业增加值起到支撑。整体来看, 国内5月经济数据显示新质生产力相关行业依旧引领经济, 对工业生产、盈利以及出口有显著支撑。然而, 芯片成本高企的冲击已开始由下游人工智能平台公司 (芯片需求端) 向上游芯片市场上传导, 负反馈效果或对AI行情产生扰动。</p>  <p>更多资讯请关注!</p>					

重点关注

6/30 9:30 中国6月官方制造业、非制造业、综合PMI  
6/30 22:00 美国美国5月JOLTS职位空缺  
7/1 17:30 美国6月挑战者企业裁员人数; 20:15 美国6月ADP变动人数  
7/2 20:30 美国6月非农就业人数、失业率、劳动参与率

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 IM: 中证1000 IO:沪深300期权

研究员: 廖宏斌  
期货从业资格号F30825507 期货投资咨询从业证书号Z0020723  
微信号: yanjiufuwu  
电话: 0595-86778969

**免责声明:** 本报告中的信息均来源于公开可获得资料, 瑞达期货股份有限公司力求准确可靠, 但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证, 据此投资, 责任自负。本报告不构成个人投或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有, 未经书面许可, 任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发, 需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院, 且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

瑞达研究