

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)	4229.2	+59.6↑	IF次主力合约 (2206)	4194.4	+62.6↑
	IH主力合约 (2206)	2884.8	+52.4↑	IH次主力合约 (2206)	2850.0	+54.2↑
	IC主力合约 (2206)	6281.2	+77.8↑	IC次主力合约 (2206)	6243.2	+87.8↑
	IF-IH当月合约价差	1344.4	+0.4↑	IC-IF当月合约价差	2052.0	+17.4↑
				IC-IH当月合约价差	3396.4	+17.8↑
	IF当季-当月	-66.2	+1.8↑	IF下季-当月	-87.2	+6.4↑
	IH当季-当月	-46.8	+0.4↑	IH下季-当月	-47.8	-4.6↓
IC当季-当月	-124.0	+11.6↑	IC下季-当月	-229.6	+17.8↑	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-21004	-2241.0↓	IH前20名净持仓	-19,067	+695.0↑
	IC前20名净持仓	-17214	+4068.0↑			
现货价格	沪深300	4222.31	+33.0↑	IF主力合约基差	6.9	+46.0↑
	上证50	2882.70	+38.0↑	IH主力合约基差	2.1	+45.6↑
	中证500	6275.57	+42.0↑	IC主力合约基差	5.6	+63.4↑
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,992.62	+489.43↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,422.07	+89.19↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-135.19	+39.44↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+100
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-387.91	-269.30↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	42.08	-7.93↓	Shibor (日, %)	1.413	+0.01↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2206)	52.80	+19.20↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	21.09	+5.77↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2206)	28.60	-24.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	21.31	+7.27↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.20	-0.36↓	成交量PCR (%)	98.15	-1.35↓
Wind市场强弱分析	全部A股	5.40	+0.70↑	技术面	4.20	-0.80↓
	资金面	6.60	+2.20↑			
行业消息	<p>1. 国务院办公厅发布《关于进一步推进省以下财政体制改革工作的指导意见》，要求清晰界定省以下财政事权和支出责任，理顺省以下政府间收入关系，参照税种属性划分收入。将税基流动性强、区域间分布不均、年度间收入波动较大的税收收入作为省级收入或由省级分享较高比例；将税基较为稳定、地域属性明显的税收收入作为市县级收入或由市县级分享较高比例。对金融、电力、石油、铁路、高速公路等领域税费收入，可作为省级收入，也可在相关市县间合理分配。除按规定上缴财政的国有资本经营收益外，逐步减少直至取消按企业隶属关系划分政府间收入的做法。</p>					<p>更多观点请咨询!</p>
观点总结	<p>A股主要指数集体收涨。沪指全天走出先抑后扬地局势，尾盘显著翻红。创业板指盘中一度跌超3%，尾盘回归平盘上方。三期指均收涨，沪深300以及上证50午后走势较强。沪深两市成交额放大，北向资金小幅净流入。结合近期外围市场的波动来看，A股韧性较强，国内市场情绪有明显改善。外资持续流入，更加有助于A股走出独立行情。然而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。预计短线指数于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