

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 (2606)	4682.6	-103.6↓	IF次主力合约 (2609)	4588.8	-102.6↓
	IH主力合约 (2606)	2813.0	-36.0↓	IH次主力合约 (2609)	2768.0	-36.6↓
	IC主力合约 (2606)	7935.0	-267.6↓	IC次主力合约 (2609)	7755.4	-262.4↓
	IM主力合约 (2606)	8072.8	-225.8↓	IM次主力合约 (2609)	7843.2	-220.2↓
	IF-IH当月合约价差	1869.6	-63.2↓	IC-IF当月合约价差	3252.4	-161.4↓
	IM-IC当月合约价差	137.8	+36.6↑	IC-IH当月合约价差	5122.0	-224.6↓
	IM-IF当月合约价差	3390.2	-124.8↓	IM-IH当月合约价差	5259.8	-188.0↓
	IF当季-当月	-93.8	+3.0↑	IF下季-当月	-152.6	+3.6↑
	IH当季-当月	-45.0	+1.0↑	IH下季-当月	-66.6	-1.6↓
	IC当季-当月	-179.6	+10.2↑	IC下季-当月	-342.2	+19.6↑
IM当季-当月	-229.6	+6.6↑	IM下季-当月	-442.8	+18.0↑	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	28,832.00	-12.0↓	IH前20名净持仓	18,293.00	-727.0↓
	IC前20名净持仓	39,845.00	+401.0↑	IM前20名净持仓	51,864.00	+900.0↑
现货价格	沪深300	4713.64	-103.3↓	IF主力合约基差	-31.0	+9.1↑
	上证50	2,825.0	-40.9↓	IH主力合约基差	-12.0	+9.9↑
	中证500	7,963.5	-287.7↓	IC主力合约基差	-28.4	+32.1↑
	中证1000	8,081.3	-259.7↓	IM主力合约基差	-8.5	+40.7↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	28,234.29	-2772.61↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	29,066.88	-139.98↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	4047.71	+396.02↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-110.0	+2185.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-948.91	-1163.61↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	16.27	-43.07↓	Shibor (日, %)	1.354	+0.030↑
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2606)	63.20	-49.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.63	+2.29↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2606)	79.00	+41.40↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.63	+1.43↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.28	+1.58↑	成交量PCR (%)	83.32	+13.32↑
				持仓量PCR (%)	67.13	-4.47↓
行业消息	<p>1、美国5月非农就业人口新增17.2万人，远超市场预期的8.5万人，失业率持平于4.3%，时薪环比上涨0.3%，均符合预期。美国3月和4月非农就业数据合计上修9.3万人，使得过去三个月就业增幅创逾两年来最强表现。</p>					
观点总结	<p>A股主要指数收盘普遍大幅下跌，三大指数低开震荡，上证指数失守4000点。中小盘股弱于大盘蓝筹股。截止收盘，上证指数跌1.7%，深证成指跌3.22%，创业板指跌3.69%。沪深两市成交额明显回落。全市场近4600只个股下跌。行业板块普遍下跌，有色金属、电子、国防军工等板块大幅下挫，仅银行、煤炭板块逆市上涨。海外方面，芯片设计商高通最新营收数据不及市场预期，令投资者对人工智能投资过度透支感到担忧。同时，美国5月非农就业人数超预期上行，结合此前公布的职位空缺数和ADP就业报告，可以看出劳动市场仍具备一定韧性，令美联储加息预期进一步上升。国内方面，经济基本面，5月我国三大官方PMI指数均维持在荣枯线上方，其中，制造业PMI较上月下滑，非制造业及综合PMI则呈现上升。然而，高技术制造业与装备制造业PMI仍在进一步走高。消息面，存储芯片巨头长鑫科技科创板IPO过会后，重量级IPO使得市场对板块流动性被稀释抱有担忧。芯片板块震荡走弱，拖累期指下跌。整体来看，新质生产力对经济的支撑利好相关行业股价，然而，美联储加息预期的升温带来的流动性趋紧预期，令海外人工智能浪潮有负面影响，同时海外人工智能巨头上市带来的虹吸效果以及此前国内长鑫科技上会均对A股科技板块产生流动性稀释，使得相关板块承压，市场整体短期或步入震荡态势。</p>					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

重点关注

待定 中国5月贸易数据  
待定 中国5月金融数据  
6/10 9:30 中国5月CPI、PPI  
6/10 20:30 美国5月CPI、核心CPI  
6/10 21:45 加拿大央行利率决议  
6/11 20:30 美国5月PPI、核心PPI

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