

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)	4743.6	+64.61	IF次主力合约 (2609)	4647.6	+62.41
	IH主力合约 (2606)	2817.2	+8.81	IH次主力合约 (2609)	2772.2	+8.21
	IC主力合约 (2606)	8112.4	+195.41	IC次主力合约 (2609)	7920.4	+180.21
	IM主力合约 (2606)	8233.4	+187.01	IM次主力合约 (2609)	7993.0	+174.01
	IF-IH当月合约价差	1926.4	+56.81	IC-IF当月合约价差	3368.8	+116.41
	IM-IC当月合约价差	121.0	-16.81	IC-IH当月合约价差	5295.2	+173.21
	IM-IF当月合约价差	3489.8	+99.61	IM-IH当月合约价差	5416.2	+156.41
	IF当季-当月	-96.0	-2.21	IF下季-当月	-159.8	-7.21
	IH当季-当月	-45.0	0.0	IH下季-当月	-62.6	+4.01
	IC当季-当月	-192.0	-12.41	IC下季-当月	-370	-27.81
IM当季-当月	-240.4	-10.81	IM下季-当月	-469	-26.21	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	27,688.00	-993.01	IH前20名净持仓	22,189.00	+1761.01
	IC前20名净持仓	35,242.00	-3221.01	IM前20名净持仓	50,104.00	-6186.01
现货价格	沪深300	4801.81	+88.21	IF主力合约基差	-58.2	-27.21
	上证50	2,842.7	+17.71	IH主力合约基差	-25.5	-13.51
	中证500	8,176.2	+212.71	IC主力合约基差	-63.8	-35.31
	中证1000	8,318.7	+237.41	IM主力合约基差	-85.3	-76.81
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	26,667.33	-1566.961	两融余额 (前一交易日, 亿元)	28,828.95	-237.931
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	3700.65	-347.061	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-2.0	+1530.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-1163.61	+446.791	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	60.13	+43.861	Shibor (日, %)	1.384	+0.0301
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2606)	36.40	+7.801	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	17.18	-2.621
	IO平值看跌期权收盘价 (2606)	92.00	-52.001	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.74	-2.211
	沪深300指数20日波动率 (%)	18.77	+1.491	成交量PCR (%)	70.63	-12.891
				持仓量PCR (%)	69.78	+3.051
行业消息	<p>1、6月9日, 海关总署发布数据显示, 中国5月出口 (以美元计价) 同比增19.4%, 前值增14.1%; 进口增27.4%, 前值增25.3%; 贸易顺差1054.3亿美元, 前值848.2亿美元。中国5月出口 (以人民币计价) 同比增13.8%, 前值增9.8%; 进口增21.5%, 前值增20.6%; 贸易顺差7239.8亿元, 前值5856.9亿元。</p> <p>2、多家主要AI芯片设计企业已悄然开始将英特尔纳入备选代工商。谷歌已正式向英特尔下单, 计划于2028年生产逾300万枚TPU。英伟达则正在对英特尔18A制造工艺展开测试, 评估其是否能够用于生产下一代GPU架构。与此同时, SK海力士也在测试其内存与英特尔封装技术的兼容性。</p> <p>3、交易所网站显示, 燧原科技科创板IPO申请、粤芯半导体创业板IPO申请将于6月15日上会。国产GPU“四小龙”燧原科技本次IPO拟募集资金约60亿元, 粤芯半导体计划募资75亿元。</p>					
观点总结	<p>A股主要指数收盘集体大幅上涨, 三大指数高开高走, 午后加速上行。中小盘股强于大盘蓝筹股。截止收盘, 上证指数涨1.28%, 深证成指涨3.02%, 创业板指涨3.93%。沪深两市成交额明显回落。行业板块普遍下跌, 综合、电子、通信等板块大幅上扬, 煤炭、石油石化板块领跌。海外方面, 包括谷歌、英伟达、SK海力士在内的多家AI芯片设计企业已开始将英特尔纳入备选代工商, 其中谷歌已正式向英特尔下单超300万枚TPU。消息带动AI交易重燃。此外, 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月我国进出口延续高增长态势, 出口边际增速高于进口, 带动贸易顺差上行。同时, 高新技术产品出口增速大幅领先整体水平。消息面, 燧原科技与粤芯半导体申请IPO, 而此前长鑫科技、宇树科技已相继过会, 具有硬实力的科技企业陆续申请IPO, 反映出当前市场对AI主题的热情依旧存在, 但头部科技企业集中上市后也将对行业流动性产生稀释。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, 市场对于AI行情的情绪已十分谨慎, 不及预期的数据或消息均会加剧市场波动, 加上美联储加息预期的升温带来的流动性趋紧预期, 对海外人工智能浪潮有负面影响, 最后海内外科技巨头相继递交IPO申请后带来的流动性稀释效果, 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资建议，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