

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)	4880.0	+113.6↑	IF次主力合约 (2609)	4784.6	+116.4↑
	IH主力合约 (2606)	2938.6	+45.8↑	IH次主力合约 (2609)	2900.6	+52.6↑
	IC主力合约 (2606)	8384.8	+273.6↑	IC次主力合约 (2609)	8206.6	+282.2↑
	IM主力合约 (2606)	8475.2	+283.4↑	IM次主力合约 (2609)	8244.6	+287.4↑
	IF-IH当月合约价差	1941.4	+68.8↑	IC-IF当月合约价差	3504.8	+157.4↑
	IM-IC当月合约价差	90.4	+10.8↑	IC-IH当月合约价差	5446.2	+226.2↑
	IM-IF当月合约价差	3595.2	+168.2↑	IM-IH当月合约价差	5536.6	+237.0↑
	IF当季-当月	-95.4	+2.6↑	IF下季-当月	-165.6	-3.2↓
	IH当季-当月	-38.0	+7.2↑	IH下季-当月	-54	+10.4↑
	IC当季-当月	-178.2	+11.4↑	IC下季-当月	-356.8	+11.4↑
IM当季-当月	-230.6	+7.6↑	IM下季-当月	-462.6	-0.8↓	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	25,900.00	+1950.0↑	IH前20名净持仓	25,487.00	+2921.0↑
	IC前20名净持仓	38,411.00	+5484.0↑	IM前20名净持仓	57,776.00	+1869.0↑
现货价格	沪深300	4891.71	+114.4↑	IF主力合约基差	-11.7	-4.2↓
	上证50	2,938.7	+47.9↑	IH主力合约基差	-0.1	-6.5↓
	中证500	8,406.8	+300.5↑	IC主力合约基差	-22.0	-33.0↓
	中证1000	8,521.2	+318.4↑	IM主力合约基差	-46.0	-40.0↓
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	30,507.42	-1853.69↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	28,734.82	-1.44↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	4910.28	+1517.06↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-8185.0	+10250.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+106.64	+685.18	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	70.65	-0.37↓	Shibor (日, %)	1.419	+0.021↑
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2606)	31.40	+23.60↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	16.61	-0.54↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2606)	53.80	-86.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	16.61	-0.42↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	19.90	+1.81↑	成交量PCR (%)	65.75	+8.66↑
				持仓量PCR (%)	77.38	+4.75↑
行业消息	<p>1、央行发布数据显示, 今年前五个月, 我国新增人民币贷款9.11万亿元; 社会融资规模增量累计为17.48万亿元, 比上年同期少1.16万亿元。5月末, M2余额同比增长8.6%。</p> <p>2、美国总统特朗普表示, 美国与伊朗协议已达成, 特此全权批准霍尔木兹海峡免费通行, 同时也授权立即解除美国海军对伊朗封锁。巴基斯坦总理夏巴兹·谢里夫表示, 经过密集谈判, 美国与伊朗和平协议已达成。双方宣布立即、永久停止所有战线军事行动, 黎巴嫩境内战事亦同步终止。协议正式签署仪式将于6月19日在瑞士举行。</p>					 <p>更多观点请咨询!</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, 中小盘股强于大盘蓝筹股。截止收盘, 上证指数涨1.61%, 深证成指涨3.79%, 创业板指涨5.3%。沪深两市成交额明显回落。全市场3900只个股上涨。行业板块普遍上涨, 电子、通信板块大幅攀升, 煤炭板块逆市大幅走弱。海外方面, 美国总统特朗普表示, 美国与伊朗协议已达成, 特此全权批准霍尔木兹海峡免费通行, 同时也授权立即解除美国海军对伊朗封锁。同时伊朗方面也确认达成协议, 并承诺不生产也不获取核武器。协议正式签署仪式将于6月19日在瑞士举行。美伊达成协议对市场风险偏好有明显修复。国内方面, 经济基本面, 贸易端, 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。物价端, 在PPI边际增速大于CPI, 令两者正剪刀差进一步走阔。金融数据上, A股市值与住户存款比值进一步上升, 同时居民存款与M2增速负剪刀差进一步走阔。整体来看, 海外地缘风险因素消退, 将对市场起到明显修复效果, 同时, 协议达成后霍尔木兹海峡重新开放也将缓解油价带来的通胀压力, 将削弱美联储加息的必要性, 对全球风险资产有利好效果。最后, 国内5月金融数据表明, 居民存款仍在加速流入股市, 为市场带来增量资金。股指后续将重回上行通道。</p>					 <p>更多资讯请关注!</p>

重点关注

6/16 10:00 中国5月规上工业增加值、固定资产投资、社会消费品零售总额、房地产数据  
6/17 20:30 美国5月零售销售  
6/18 2:00 美联储利率决议; 2:30 美联储新闻发布会

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