

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)	4875.2	+10.0↓	IF次主力合约 (2609)	4767.0	-0.2↓
	IH主力合约 (2606)	2911.0	-20.0↓	IH次主力合约 (2609)	2872.0	-18.0↓
	IC主力合约 (2606)	8475.8	+120.0↑	IC次主力合约 (2609)	8278.0	+105.2↑
	IM主力合约 (2606)	8602.4	+149.0↑	IM次主力合约 (2609)	8349.0	+131.8↑
	IF-IH当月合约价差	1964.2	+22.8↑	IC-IF当月合约价差	3600.6	+95.8↑
	IM-IC当月合约价差	126.6	+36.2↑	IC-IH当月合约价差	5564.8	+118.6↑
	IM-IF当月合约价差	3727.2	+132.0↑	IM-IH当月合约价差	5691.4	+154.8↑
	IF当季-当月	-108.2	-12.8↓	IF下季-当月	-179.2	-13.6↓
	IH当季-当月	-39.0	-1.0↓	IH下季-当月	-56.6	-2.6↓
	IC当季-当月	-197.8	-19.6↓	IC下季-当月	-377.8	-21.0↓
IM当季-当月	-253.4	-22.8↓	IM下季-当月	-492.6	-30.0↓	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	23,992.00	-325.0↓	IH前20名净持仓	24,120.00	-710.0↓
	IC前20名净持仓	31,490.00	-4551.0↓	IM前20名净持仓	53,116.00	-271.0↓
现货价格	沪深300	4884.23	-7.5↓	IF主力合约基差	-9.0	+2.7↑
	上证50	2,914.0	-24.7↓	IH主力合约基差	-3.0	-2.9↓
	中证500	8,508.0	+101.2↑	IC主力合约基差	-32.2	-10.2↓
	中证1000	8,646.4	+125.2↑	IM主力合约基差	-44.0	+2.0↑
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	30,863.47	+356.05↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	28,979.38	+244.56↑
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	4097.23	-813.05↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-1530.0	+4495.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+685.18	-170.37↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	49.38	-21.27↓	Shibor (日, %)	1.423	+0.004↑
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2606)	27.00	-4.40↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	17.37	+0.76↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2606)	50.80	-3.00↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.37	+0.76↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	19.87	-0.03↓	成交量PCR (%)	66.41	+0.66↑
				持仓量PCR (%)	78.07	+0.69↑
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>3、6月16日, 国家统计局公布数据, 5月规模以上工业增加值同比增长4.5%, 前值增长4.1%; 1-5月累计同比增长5.4%。1-5月固定资产投资同比下降4.1%, 前值下降1.6%。基础设施投资同比增长0.6%, 制造业投资下降0.4%, 房地产开发投资下降16.2%。5月社会消费品零售总额同比下降0.6%, 前值增长0.2%; 1-5月累计同比增长1.4%。全国调查失业率5.1%, 前值5.2%。</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, 中小盘股强于大盘蓝筹股。截止收盘, 上证指数跌0.11%, 深证成指涨0.93%, 创业板指涨1.72%。沪深两市成交额小幅回升。行业板块多数下跌, 交通运输、煤炭等板块跌幅靠前, 建筑材料板块大幅走强。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, 5月份, 我国进出口与规上工业增加值较4月份上升, 高技术行业及产品持续支撑工业生产与出口, 但传统产业与消费端, 则相对疲弱, 房地产投资进一步下行, 社零自2022年12月以来首次落至负值。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月经济数据显示新质生产力相关行业依旧维持韧性, 且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>					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!

重点关注

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