

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)	4928.0	+50.01	IF次主力合约 (2609)	4823.0	+49.81
	IH主力合约 (2606)	2935.0	+20.81	IH次主力合约 (2609)	2894.4	+18.81
	IC主力合约 (2606)	8613.2	+135.01	IC次主力合约 (2609)	8429.0	+144.81
	IM主力合约 (2606)	8695.0	+85.41	IM次主力合约 (2609)	8445.0	+86.21
	IF-IH当月合约价差	1993.0	+28.81	IC-IF当月合约价差	3685.2	+84.61
	IM-IC当月合约价差	81.8	-44.81	IC-IH当月合约价差	5678.2	+113.41
	IM-IF当月合约价差	3767.0	+39.81	IM-IH当月合约价差	5760.0	+68.61
	IF当季-当月	-105.0	+3.21	IF下季-当月	-185	-5.81
	IH当季-当月	-40.6	-1.61	IH下季-当月	-63	-6.41
	IC当季-当月	-184.2	+13.61	IC下季-当月	-366	+11.81
IM当季-当月	-250.0	+3.41	IM下季-当月	-494	-1.41	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	23,481.00	-302.01	IH前20名净持仓	22,466.00	+578.01
	IC前20名净持仓	33,770.00	+1308.01	IM前20名净持仓	53,660.00	+2585.01
现货价格	沪深300	4931.39	+47.21	IF主力合约基差	-3.4	+5.61
	上证50	2,934.5	+20.51	IH主力合约基差	0.5	+3.51
	中证500	8,627.1	+119.11	IC主力合约基差	-13.9	+18.31
	中证1000	8,704.5	+58.11	IM主力合约基差	-9.5	+34.51
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	31,140.39	+276.921	两融余额 (前一交易日, 亿元)	29,248.62	+269.241
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	3829.90	-267.331	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-1590.0	+4203.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-170.37	-215.581	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	31.14	-18.241	Shibor (日, %)	1.415	-0.0081
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2606)	21.60	+9.001	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	18.15	+0.351
	IO平值看跌期权收盘价 (2606)	46.40	-39.401	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	18.15	+0.711
	沪深300指数20日波动率 (%)	20.13	+0.261	成交量PCR (%)	69.73	+3.091
				持仓量PCR (%)	80.94	+2.881
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股主要指数收盘集体上涨, 三大指数低开高走, 上证指数重回4100点。截止收盘, 上证指数涨0.4%, 深证成指涨1.31%, 创业板指涨1.56%。沪深两市成交额小幅回升。行业板块多数下跌, 商贸零售、煤炭、钢铁等板块跌幅靠前, 电子、建筑材料板块逆市大幅走强。海外方面, 美伊和平协议将于6月19日在瑞士签署, 该消息持续修复市场风险偏好。此外, 6月18日凌晨, 美联储将公布利率决议, 本次会议也是新任美联储主席沃什主持的首场会议, 市场关注其在会后发布会上的政策立场。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!

6/18 2:00 美联储利率决议; 2:30 美联储新闻发布会

重点关注

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