

撰写人: 张昕 从业资格号: F3073677 投资咨询从业证书号: Z0015602

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 (2206)	4277.4	+83.4↑	IF次主力合约 (2206)	4244.8	+87.2↑
	IH主力合约 (2206)	2920.6	+61.6↑	IH次主力合约 (2206)	2889.4	+64.2↑
	IC主力合约 (2206)	6251.6	+26.0↑	IC次主力合约 (2206)	6206.8	+28.6↑
	IF-IH当月合约价差	1356.8	+12.4↑	IC-IF当月合约价差	1974.2	-77.8↓
				IC-IH当月合约价差	3331.0	-65.4↓
	IF当季-当月	-61.4	+4.8↑	IF下季-当月	-78.4	+8.8↑
	IH当季-当月	-39.0	+7.8↑	IH下季-当月	-38	+9.8↑
IC当季-当月	-129.2	-5.2↓	IC下季-当月	-240.6	-11.0↓	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-21531	-527.0↓	IH前20名净持仓	-18,576	+491.0↑
	IC前20名净持仓	-13929	+3285.0↑			
现货价格	沪深300	4278.22	+55.9↑	IF主力合约基差	-0.8	+48.2↑
	上证50	2923.99	+41.3↑	IH主力合约基差	-3.4	+35.8↑
	中证500	6261.06	-14.5↓	IC主力合约基差	-9.5	-29.6↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	12,987.41		两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,479.28	+57.21↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+39.44	+133.59↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-2100	+100
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-269.30	+93.36↑	MLF (续作量, 净投放, 亿元)	2000	0
	上涨股票比例 (日, %)	43.55	+1.47↑	Shibor (日, %)	1.413	0.00
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2206)	22.00	+7.20↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	21.14	-5.59↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2206)	40.00	-84.00↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	15.68	-22.00↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.25	+0.05↑	成交量PCR (%)	66.97	-31.38↓
Wind市场强弱分析	全部A股	5.50	+0.10↑	技术面	4.40	+0.20↑
	资金面	6.70	+0.10↑			
行业消息	1.国家统计局: 1-5月份, 全国固定资产投资 (不含农户) 205964亿元, 同比增长6.2%。其中, 民间固定资产投资117128亿元, 同比增长4.1%。从环比看, 5月份固定资产投资 (不含农户) 增长0.72%。1—5月份, 社会消费品零售总额171689亿元, 同比下降1.5%。5月份, 社会消费品零售总额33547亿元, 同比下降6.7%。其中, 除汽车以外的消费品零售额30361亿元, 下降5.6%。					<p>更多观点请咨询!</p>
观点总结	A股主要指数集体收涨。沪指早盘强势走高, 盘中涨幅一度接近2%, 回升至3300点上方。创业板指亦全天高位震荡, 尾盘涨幅有所收窄。三期指走势分化, 沪深300以及上证50走势较强, 收涨超过1%。中证500小幅回调。沪深两市成交额放大, 北向资金大幅净流入。结合近期外围市场的波动来看, A股韧性较强, 国内市场情绪有明显改善。外资持续流入, 更加有助于A股走出独立行情。当前板块间热点轮动仍然较快, 资金多空分歧较强, 短期股指延续涨势取决于市场量能能否大幅提升。预计短线指数于3300点压力位前存在调整倾向, 需密集关注政策面、资金面以及外部环境因素的变化。资产配置层面, 关注稳增长主线、疫后修复主线以及中报业绩较好板块。技术面上, 指数短线蓄势反弹, 结合低估值以及疫情修复逻辑, 在稳增长政策发力下, 建议轻仓介入多IC合约。					<p>更多资讯请关注!</p>
重点关注	6-16 20: 30 美国6月11日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国5月新屋开工(万户); 美国5月营建许可(万户) 6-17 11: 00 日本央行公布利率决议					

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 IO:沪深300期权