

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) | 4059.2 | -13.0↓ | IF次主力合约 (2206) | 4024.2 | -14.8↓ |
| | IH主力合约 (2206) | 2784.8 | -16.8↓ | IH次主力合约 (2206) | 2748.0 | -18.4↓ |
| | IC主力合约 (2206) | 5970.0 | -5.2↓ | IC次主力合约 (2206) | 5914.2 | -4.0↓ |
| | IF-IH当月合约价差 | 1274.4 | +2.6↑ | IC-IF当月合约价差 | 1910.8 | +5.0↑ |
| | | | | IC-IH当月合约价差 | 3185.2 | +7.6↑ |
| | IF当季-当月 | -57.0 | -1.0↓ | IF下季-当月 | -77.2 | -0.8↓ |
| | IH当季-当月 | -46.8 | -3.0↓ | IH下季-当月 | -50 | -4.4↓ |
| | IC当季-当月 | -143.0 | -0.6↓ | IC下季-当月 | -256.4 | -1.4↓ |
| 期货持仓头寸 (净多) | IF前20名净持仓 | -21101 | +360.0↑ | IH前20名净持仓 | -17,403 | -969.0↓ |
| | IC前20名净持仓 | -22022 | +2068.0↑ | | | |
| 现货价格 | 沪深300 | 4083.18 | -8.3↓ | IF主力合约基差 | -24.0 | -10.0↓ |
| | 上证50 | 2798.07 | -15.2↓ | IH主力合约基差 | -13.3 | -12.6↓ |
| | 中证500 | 6023.64 | -2.6↓ | IC主力合约基差 | -53.6 | -5.0↓ |
| Wind市场强弱分析 | A股成交额 (日, 亿元) | 8,850.96 | -509.33↓ | 两融余额 (前一交易日, 亿元) | 15,226.26 | -5.70↓ |
| | 陆股通 (昨日, 今日, 亿元) | +138.65 | -178.61↓ | 逆回购 (到期量, 操作量, 亿元) | -100 | +100 |
| | 主力资金 (昨日, 今日, 亿元) | +64.90 | +12.47↑ | MLF (续作量, 净投放, 亿元) | | |
| | 上涨股票比例 (日, %) | 58.04 | -11.96↓ | Shibor (日, %) | 1.413 | -0.18↓ |
| 沪深300指数期权 | IO平值看涨期权收盘价 (2206) | 50.20 | -7.00↓ | IO平值看涨期权隐含波动率 (%) | 19.79 | +0.94↑ |
| | IO平值看跌期权收盘价 (2206) | 91.40 | +2.60↑ | IO平值看跌期权隐含波动率 (%) | 19.97 | -0.88↓ |
| | 沪深300指数20日波动率 (%) | 18.66 | -1.67↓ | 成交量PCR (%) | 101.59 | +8.66↑ |
| Wind市场强弱分析 | 全部A股 | 5.80 | -1.40↓ | 技术面 | 5.80 | -1.20↓ |
| | 资金面 | 5.80 | -1.60↓ | | | |

| | | |
|------|---|-----------------|
| 行业消息 | <p>1.6月1日公布的5月财新中国制造业采购经理人指数 (PMI) 录得48.1, 高于4月2.1个百分点, 与3月持平, 同为2020年3月以来次低, 显示近期疫情形势好转带动制造业景气度回升, 但各种约束仍然明显。</p> | <p>更多观点请咨询!</p> |
| 观点总结 | <p>A股主要指数走势分化, 上证指数早盘窄幅整理为主, 午后一度回落走低; 深成指盘中探底回升, 创业板指强势震荡上扬, 盘中一度涨1.5%; 两市成交额略有下降。三大期指小幅收跌, 中证500尾盘跌幅收窄至平盘附近。稳增长政策的密集出台和不断加码一方面显示出了政府稳住经济大盘的决心, 另一方面也对经济形成实质性利好。短线来看, 政策底部较为明晰, 然而疫情发展对经济的影响程度存在较多不确定性, 稳增长政策的密集部署下, 效力累积从而实现了对疫情负面影响的缓冲在时间维度上亦存在较多分歧。预计指数短线上行空间面临一定压力, 静待基本面拐点预期来临支撑反转动能。乐观来看, 二季度经济有望成为全年经济低点, 中长线上不排除当前逢低布局的可操作性, 关注基建以及消费领域的资产配置机会。技术面上, 指数短线或有反复, 结合低估值以及疫情修复逻辑, 在稳增长政策发力下, 建议轻仓做多IC合约。</p> | <p>更多资讯请关注!</p> |
| 重点关注 | <p>6-1 09: 45 中国5月财新制造业PMI; 22: 00 美国5月ISM制造业指数 6-2 20: 15 美国5月ADP就业人数变动(万人); 22: 00 美国4月耐用品订单环比终值; 23: 00 美国5月27日当周EIA原油库存变动(万桶) 6-3 20: 30 美国5月失业率 22: 00 美国5月ISM非制造业指数</p> | |