

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 (2207)	4337.0	-79.6↓	IF次主力合约 (2209)	4306.6	-79.6↓
	IH主力合约 (2207)	2926.4	-49.8↓	IH次主力合约 (2209)	2920.0	-49.8↓
	IC主力合约 (2207)	6303.8	-97.0↓	IC次主力合约 (2209)	6226.4	-99.4↓
	IF-IH当月合约价差	1410.6	-28.6↓	IC-IF当月合约价差	1966.8	-6.8↓
				IC-IH当月合约价差	3377.4	-35.4↓
	IF当季-当月	-30.4	+0.4↑	IF下季-当月	-54.6	+1.2↑
	IH当季-当月	-6.4	-1.2↓	IH下季-当月	-2.6	-2.2↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-16,872.00	-1880.0↓	IH前20名净持仓	-21,531	+1355.0↑
	IC前20名净持仓	-10,329.00	-2871.0↓			
现货价格	沪深300	4354.62	-74.2↓	IF主力合约基差	-17.6	+55.0↑
	上证50	2942.30	-51.0↓	IH主力合约基差	-15.9	+28.1↑
	中证500	6319.14	-85.3↓	IC主力合约基差	-15.3	+64.1↑
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,087.35	-206.28↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,206.33	-43.24↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+12.36	-10.68↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-30	+30
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-329.69	-558.63↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	29.69	-32.68↓	Shibor (日, %)	1.223	+0.007↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	38.60	-49.80↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.93	-1.39↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	50.60	+24.00↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.88	-4.35↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.32	+0.65↑	成交量PCR (%)	106.36	+19.86↑
Wind市场强弱分析	全部A股	3.40	-1.50↓	技术面	3.00	-2.30↓
	资金面	3.80	-0.60↓			
行业消息	1、中国汽车工业协会: 6月份, 我国汽车产销分别完成249.9万辆和250.2万辆, 同比分别增长28.2%和23.8%。其中乘用车产销223.9万辆和222.2万辆, 同比分别增长43.6%和41.2%。中国汽车工业协会相关负责人分析指出, 6月以来, 我国汽车产业受疫情影响的供应链已全面恢复, 企业加快生产节奏弥补损失。在国家购置税减半政策、地方政府促汽车消费政策叠加下, 我国汽车市场表现良好。					 <p>更多观点请咨询!</p>
观点总结	A股主要指数集体回调。沪深全天低开低走, 尾盘收跌超过1%。创业板指全天低位震荡, 收跌接近2%。三期指回调幅度均超1%。沪深两市呈现缩量下跌的局势, 市场短线上行阻力上升。近期半年报业绩预告期下, 市场预期波动放大, 叠加指数短线反弹接近年线位置, 短线上预计存在反复趋势。关注企业半年报业绩披露以及本周最新宏观数据, 核心经济指标的修复程度将是后期短线市场情绪的支撑, 后续行情波动亦或放大, 建议投资者逢低布局。整体上看, 当前A股依然呈现相对强势走势, 结合估值水平尚未达到合理水平以上, 中长期市场仍具有一定的上行空间。技术面上, 指数中长线价值明确, 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	7-11 待定 中国6月M2货币供应同比; 中国6月M1货币供应同比; 中国6月M0货币供应同比; 中国6月新增人民币贷款(亿人民币); 中国6月社会融资规模增量(亿人民币) 7-13 待定 中国6月贸易帐(按人民币计)(亿人民币); 中国6月进口同比(按人民币计); 中国6月出口同比(按人民币计); 中国6月进口同比(按美元计); 中国6月出口同比(按美元计); 中国6月贸易帐(按美元计)(亿美元); 20: 30 美国6月核心CPI同比; 美国6月CPI同比; 美国6月核心CPI环比; 美国6月CPI环比 7-14 20: 30美国7月9日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国6月核心PPI同比; 美国6月PPI同比; 美国6月核心PPI环比; 美国6月PPI环比					

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