

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)	4144.4	+75.8↑	IF次主力合约 (2206)	4109.8	+76.8↑
	IH主力合约 (2206)	2814.0	+36.0↑	IH次主力合约 (2206)	2777.6	+37.8↑
	IC主力合约 (2206)	6157.8	+111.6↑	IC次主力合约 (2206)	6106.8	+116.8↑
	IF-IH当月合约价差	1330.4	+42.0↑	IC-IF当月合约价差	2013.4	+33.8↑
				IC-IH当月合约价差	3343.8	+75.8↑
	IF当季-当月	-62.6	-5.4↓	IF下季-当月	-80.8	-4.6↓
	IH当季-当月	-45.4	+3.8↑	IH下季-当月	-49	+5.8↑
IC当季-当月	-137.8	-1.0↓	IC下季-当月	-246.8	+0.6↑	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-24136	-2052.0↓	IH前20名净持仓	-17,972	-3105.0↓
	IC前20名净持仓	-24020	+559.0↑			
现货价格	沪深300	4166.09	+76.5↑	IF主力合约基差	-21.7	+73.8↑
	上证50	2825.65	+35.3↑	IH主力合约基差	-11.7	+31.8↑
	中证500	6187.44	+109.0↑	IC主力合约基差	-29.6	+107.6↑
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	11,123.29		两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,143.64	-48.41↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+112.55	+31.83↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+100
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+78.60	-49.35↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	78.19	+16.16↑	Shibor (日, %)	1.454	+0.02↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2206)	58.00	+26.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.45	+2.11↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2206)	65.40	-44.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.32	+1.31↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.80	-1.84↓	成交量PCR (%)	90.91	-1.91↓
				持仓量PCR (%)	105.76	+4.40↑
Wind市场强弱分析	全部A股	7.80	+1.30↑	技术面	7.80	+1.60↑
	资金面	7.70	+0.80↑			
行业消息	1.5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; 财新中国服务业PMI回升5.2个百分点至41.4。两个行业PMI均有回升, 带动5月财新中国综合PMI录得42.2, 高于4月5个百分点, 显示近期疫情形势好转带动经济景气度回升, 但疫情约束仍然明显。					
观点总结	A股主要指数集体飘红, 大盘呈放量上涨局势。沪指高开高走, 收涨超过1%。三大指数中, 创业板指呈强势上行, 盘中一度涨4%。中证500以及沪深300收涨接近2%。5月份官方PMI显示整体经济景气度小幅回升, 全国疫情形势好转, 复工复产逐步推进, 物流运输边际改善, 供需呈现“双回暖”。短线来看, 当前市场呈现较好上升趋势, 国内疫情修复逻辑是主要利好因素, 市场预期亦显著改善。然而市场仍需进一步确认稳增长加码下基本面数据的“持续性”向好, 因而预期或仍存在一定波动性, 需静待基本面拐点预期来临支撑反转动能。展望六月份, 疫情复苏以及政策发力下, 对行情的看法相对乐观。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。					
重点关注	6-7 20: 30 美国4月贸易帐(亿美元) 6-9 待定 中国5月M2货币供应同比; 中国5月M1货币供应同比; 中国5月M0货币供应同比; 中国5月新增人民币贷款(亿人民币); 中国5月社会融资规模增量(亿人民币); 中国5月贸易帐(按人民币计)(亿人民币); 中国5月进口同比(按人民币计); 中国5月出口同比(按人民币计); 中国5月进口同比(按美元计); 中国5月出口同比(按美元计); 20: 30 美国6月4日当周首次申请失业救济人数(万人) 6-10 09: 30 中国5月CPI同比; 中国5月PPI同比; 20: 30 美国5月核心CPI同比; 美国5月CPI同比; 22: 00 美国6月密歇根大学消费者信心指数初值					



更多观点请咨询!



更多资讯请关注!