

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)	4315.8	+76.4↑	IF次主力合约 (2209)	4287.8	+77.6↑
	IH主力合约 (2207)	2908.0	+39.4↑	IH次主力合约 (2209)	2898.0	+38.4↑
	IC主力合约 (2207)	6273.2	+139.2↑	IC次主力合约 (2209)	6187.4	+146.4↑
	IF-IH当月合约价差	1407.8	+40.0↑	IC-IF当月合约价差	1957.4	+73.2↑
				IC-IH当月合约价差	3365.2	+113.2↑
	IF当季-当月	-28.0	+4.0↑	IF下季-当月	-48	+4.0↑
	IH当季-当月	-10.0	+0.2↑	IH下季-当月	-11.4	+0.2↑
IC当季-当月	-85.8	+9.0↑	IC下季-当月	-191.2	+15.2↑	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,474.00	+1903.0↑	IH前20名净持仓	-20,288	-2126.0↓
	IC前20名净持仓	-11,679.00	-2201.0↓			
现货价格	沪深300	4343.88	+73.3↑	IF主力合约基差	-28.1	-112.9↓
	上证50	2935.88	+43.6↑	IH主力合约基差	-27.9	-72.7↓
	中证500	6300.47	+120.9↑	IC主力合约基差	-27.3	-185.3↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,759.25	+796.39↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,730.21	+52.17↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-68.20	+120.33↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+100
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-384.32	+75.63↑	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	83.02	+63.41↑	Shibor (日, %)	1.437	-0.007↓
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	74.00	+33.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	20.20	+5.16↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	106.80	-50.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	20.09	+6.06↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	15.37	+0.72↑	成交量PCR (%)	84.12	+1.82↑
Wind市场强弱分析	全部A股	8.00	+5.10↑	技术面	8.30	+6.30↑
	资金面	7.70	+3.80↑			
行业消息	1、6月22日, 中金所就中证1000股指期货、股指期权征求意见, 标志着自2015年4月中证500股指期货合约上市以来, 时隔7年A股市场再次迎来新的股指期货品种。意见稿显示, 中证1000股指期货的合约乘数为每点人民币200元, 以6月22日中证1000指数收盘价6691.81点计算, 中证1000股指期货的合约面值约为134万元。业内人士认为, 中证1000期指及期权如果推出, 将使A股市场上的中小盘股具有相应的对冲工具。					更多观点请咨询!
观点总结	A股主要指数集体收涨。沪深三大股指早盘先抑后扬, 北向资金净流入扩大, 午后场内做多情绪升温, 三大指数均收于日内高点。沪深两市成交额上升, 北向资金呈大幅净流入趋势。当前, 稳增长政策不断推进, 就业、地产以及外贸等主要经济推动因素正逐步改善, 二季度将成为全年经济拐点, 下半年经济复苏亦值得期待。预计本周市场仍有技术层面的压力, 沪指上方半年线将成为市场近期上行阻力, 然而在基本面利好偏多的情况下, 调整空间有限。技术面上, 指数短线下蓄势反弹, 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。					更多资讯请关注!
重点关注	6-23 00:50 2023年FOMC票委、芝加哥联储主席埃文斯就美国经济前景发表讲话 6-23 01:30 2023年FOMC票委哈克和2024年FOMC票委巴尔金参加关于宏观经济前景的讨论 6-23 15:30 德国6月制造业PMI初值 6-23 16:00 欧元区6月制造业PMI初值, 欧洲央行公布经济公报 6-23 20:30 美国6月18日当周首次申请失业救济人数(万人) 6-23 21:00 美联储主席鲍威尔在众议院金融服务委员会就半年度货币政策报告作证词陈述 6-23 23:00 美国6月17日当周EIA原油库存变动(万桶)					

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