

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)	4413.4	-46.2↓	IF次主力合约 (2209)	4390.0	-42.2↓
	IH主力合约 (2207)	2988.0	-20.8↓	IH次主力合约 (2209)	2976.0	-21.4↓
	IC主力合约 (2207)	6382.2	-85.8↓	IC次主力合约 (2209)	6307.0	-82.0↓
	IF-IH当月合约价差	1425.4	-27.4↓	IC-IF当月合约价差	1968.8	-42.8↓
				IC-IH当月合约价差	3394.2	-70.2↓
	IF当季-当月	-23.4	+4.0↑	IF下季-当月	-40	+4.2↑
	IH当季-当月	-12.0	-0.8↓	IH下季-当月	-18	-3.2↓
	IC当季-当月	-75.2	+2.8↑	IC下季-当月	-166.2	+11.0↑
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-20,610.00	-370.0↓	IH前20名净持仓	-19,641	+1305.0↑
	IC前20名净持仓	-8,205.00	-1722.0↓			
现货价格	沪深300	4421.36	-69.2↓	IF主力合约基差	-8.0	+44.0↑
	上证50	3009.24	-30.2↓	IH主力合约基差	-21.2	+3.4↑
	中证500	6374.30	-127.1↓	IC主力合约基差	7.9	+102.7↑
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	13,161.66	+1560.90↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,977.09	+85.23↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+46.48	-16.83↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+1000
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-59.97	-844.68↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	15.98	-40.85↓	Shibor (日, %)	1.372	-0.066↓
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	84.60	-31.20↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	20.57	+4.88↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	75.20	+22.00↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	20.29	+2.61↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.95	+1.17↑	成交量PCR (%)	79.10	-7.24↓
Wind市场强弱分析	全部A股	2.60	-4.80↓	技术面	1.60	-5.70↓
	资金面	3.60	-3.70↓			
行业消息	<p>1、中国证监会和香港证监会发布联合公告, 批准ETF纳入互联互通于7月4日正式启动。深交所、上交所及港交所同步发布首批标的ETF名单, 包括沪股通ETF共53只, 深股通ETF共30只, 港股通ETF共4只。其中, 沪股通ETF覆盖上证50ETF、上证180ETF、沪深300ETF等核心宽基产品, 以及生物医药、半导体、新能源等代表性行业主题产品。深股通ETF覆盖创业板ETF、沪深300ETF等核心宽基产品, 以及生物科技ETF、芯片ETF、碳中和ETF等代表性行业主题产品。4只港股通ETF分别为盈富基金、恒生中国企业、南方恒生科技、安硕恒生科技等股票ETF。两地监管部门表示, 将继续做好ETF纳入互联互通投资者教育和投资知识传播工作, 加强执法合作, 打击各类跨境违法违规行, 及时妥善处理重大或突发事件, 维护互联互通正常运行秩序, 保护投资者合法权益。</p>				 <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	<p>A股主要指数集体回调。沪深股指全线回调, 沪指失守3400点关口。创业板指跌破2800点关口。三期指跌幅扩大, 沪深300以及中证500跌超1%。沪深两市成交额上升。汽车板块大幅回调使得市场整体做多情绪降温。中长线看, 中国与海外经济周期错配的大环境下, 海外发达经济体增速回落叠加国内疫情逐步修复将使得A股资产将更具备吸引力。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>				 <p>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	<p>6-29 20: 30 美国一季度个人消费支出(PCE)年化季环比终值; 美国一季度实际GDP年化季环比终值          6-30 20: 30 美国6月25日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国5月个人消费支出(PCE)环比; 美国5月个人收入环比</p>					