

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)	4461.8	+45.8↑	IF次主力合约 (2209)	4435.4	+44.8↑
	IH主力合约 (2207)	3039.2	+50.0↑	IH次主力合约 (2209)	3030.0	+51.8↑
	IC主力合约 (2207)	6425.8	+42.4↑	IC次主力合约 (2209)	6351.4	+45.4↑
	IF-IH当月合约价差	1422.6	-2.8↓	IC-IF当月合约价差	1964.0	-4.8↓
				IC-IH当月合约价差	3386.6	-7.6↓
	IF当季-当月	-26.4	-3.0↓	IF下季-当月	-41.4	-1.4↓
	IH当季-当月	-9.2	+2.8↑	IH下季-当月	-14.6	+3.4↑
IC当季-当月	-74.4	+0.8↑	IC下季-当月	-176.6	-10.4↓	
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,356.00	+1254.0↑	IH前20名净持仓	-19,648	-7.0↓
	IC前20名净持仓	-11,833.00	-3628.0↓			
现货价格	沪深300	4485.01	+63.7↑	IF主力合约基差	-23.2	-71.6↓
	上证50	3058.40	+49.2↑	IH主力合约基差	-19.2	-70.4↓
	中证500	6454.08	+79.8↑	IC主力合约基差	-28.3	-71.9↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	11,597.81	-2.95↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,960.99	-16.10↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	-16.83		逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+800
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-844.68	+4.46↑	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	58.23	+42.25↑	Shibor (日, %)	1.901	+0.529↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	61.80	+17.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	20.84	+0.20↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	99.60	-33.40↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	20.79	+4.15↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.19	+0.24↑	成交量PCR (%)	76.79	-2.31↓
			持仓量PCR (%)	129.38	+8.58↑	
Wind市场强弱分析	全部A股	6.60	+4.00↑	技术面	5.80	+4.00↑
	资金面	7.40	+3.80↑			
行业消息	1、国家统计局: 6月份, 非制造业商务活动指数为54.7%, 比上月上升6.9个百分点, 重返扩张区间, 非制造业景气水平连续两个月明显回升。随着国内疫情防控形势持续向好, 稳经济一揽子政策措施加快落地生效, 我国经济总体恢复有所加快。6月份, 制造业采购经理指数、非制造业商务活动指数和综合PMI产出指数分别为50.2%、54.7%和54.1%, 高于上月0.6、6.9和5.7个百分点, 均升至扩张区间。				 <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数集体回升。沪深三大股指早盘全线反弹, 创业板指收涨2%。三期指均收涨, 涨幅超过1%。沪深两市成交额小幅下行。央行召开二季度货币政策例会, 表明统筹抓好稳就业和稳物价两个目标, 加大稳健货币政策实施力度。经济修复期, 政策面让银行让利实体经济, 促进信贷需求加快复苏。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股资产更具吸引力。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>更多资讯请关注!</p>	
重点关注	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					