

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)	4472.2	+33.0↑	IF次主力合约 (2209)	4441.2	+30.8↑
	IH主力合约 (2207)	3032.6	+9.8↑	IH次主力合约 (2209)	3022.8	+10.4↑
	IC主力合约 (2207)	6491.8	+76.6↑	IC次主力合约 (2209)	6413.0	+72.0↑
	IF-IH当月合约价差	1439.6	+21.8↑	IC-IF当月合约价差	2019.6	+51.6↑
				IC-IH当月合约价差	3459.2	+73.4↑
	IF当季-当月	-31.0	-2.4↓	IF下季-当月	-54	-8.8↓
	IH当季-当月	-9.8	+1.6↑	IH下季-当月	-12.6	+2.2↑
	IC当季-当月	-78.8	-2.6↓	IC下季-当月	-180	-6.2↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-19,318.00	+1248.0↑	IH前20名净持仓	-20,017	+492.0↑
	IC前20名净持仓	-5,747.00	+4732.0↑			
现货价格	沪深300	4496.03	+29.3↑	IF主力合约基差	-23.8	-50.8↓
	上证50	3050.15	+4.9↑	IH主力合约基差	-17.6	-22.8↓
	中证500	6523.13	+84.6↑	IC主力合约基差	-31.3	-109.9↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	11,304.75	+791.82↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,004.00	-29.00↓
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)		+45.01	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-1000	+30
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-293.62	-86.05	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	52.97	+13.13↑	Shibor (日, %)	1.418	-0.023↓
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	56.20	+5.80↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	20.55	-1.63↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	89.40	-18.60↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	21.05	+0.57↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.66	-0.78↓	成交量PCR (%)	76.43	-3.93↓
			持仓量PCR (%)	120.98	-1.81↓	
Wind市场强弱分析	全部A股	6.20	+2.00↑	技术面	5.30	+1.40↑
	资金面	7.00	+2.50↑			
行业消息	<p>1、受瞩目的ETF互联互通正式启航。首批纳入ETF通的合资格标的共有87只，包括沪股通ETF共53只，深股通ETF共30只，港股通ETF共4只。多家基金公司表示，ETF互联互通机制是两地资本市场深化交流合作的重要成果，不仅为投资者提供了更加多元的投资标的，而且有望给两地市场带来一定的增量资金，尤其是给内地ETF做大做强提供了宝贵机会，长远看有利于内地基金公司发展境外机会。</p>				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	<p>A股主要指数集体回升。沪深震荡攀升，重新收回3400点关口。创业板指强势回升，涨幅接近2%。三期指均收涨，中证500涨幅超过1%。沪深两市成交额放大。市场板块轮动依然较快，前期大幅上涨的成长风格当前面临一定的反弹阻力，预计本周市场或迎来风格切换，建议投资者配置方面选择逢低位布局。上半年以来，A股经历深V反弹，相较于外围市场表现出更强的韧性。中长线看，三四季度疫情得到有效控制下，国内稳增长政策持续发力，生产需求以及消费需求的复苏将继续拉升经济增长动能。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。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>7-5 09: 45 中国6月财新服务业PMI; 中国6月财新综合PMI; 22: 00 美国5月扣除飞机非国防资本耐用品订单环比终值; 美国5月耐用品订单环比终值 7-6 22: 00 美国6月ISM非制造业指数 7-7 待定 中国6月外汇储备(亿美元); 20: 30 美国7月2日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国5月贸易帐(亿美元); 23: 00 美国7月1日当周EIA原油库存变动(万桶)</p>					