

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)	4459.4	-3.0↓	IF次主力合约 (2209)	4427.2	-4.8↓
	IH主力合约 (2207)	3029.6	+3.4↑	IH次主力合约 (2209)	3020.6	+3.4↑
	IC主力合约 (2207)	6476.4	-9.4↓	IC次主力合约 (2209)	6399.6	-8.8↓
	IF-IH当月合约价差	1429.8	-9.8↓	IC-IF当月合约价差	2017.0	-2.6↓
				IC-IH当月合约价差	3446.8	-12.4↓
	IF当季-当月	-32.2	-1.2↓	IF下季-当月	-58	-4.0↓
	IH当季-当月	-9.0	+0.8↑	IH下季-当月	-13.2	-0.6↓
	IC当季-当月	-76.8	+2.0↑	IC下季-当月	-179	+1.0↑
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-15,004.00	+4314.0↑	IH前20名净持仓	-19,416	+601.0↑
	IC前20名净持仓	-9,170.00	-3423.0↓			
现货价格	沪深300	4489.54	-6.5↓	IF主力合约基差	-30.1	-17.3↓
	上证50	3052.11	+2.0↑	IH主力合约基差	-22.5	-19.5↓
	中证500	6511.53	-11.6↓	IC主力合约基差	-35.1	-19.7↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	11,809.84	+505.09↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	16,106.65	+102.65↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+45.01	-13.48↓	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-1100	+30
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-86.05	-483.68↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	25.93	+12.16↑	Shibor (日, %)	1.367	-0.051↓
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	49.00	-7.20↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	22.44	+9.18↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	88.60	-0.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	17.28	-15.30↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	16.66	-0.78↓	成交量PCR (%)	84.52	+7.93↑
			持仓量PCR (%)	115.30	-6.01↓	
Wind市场强弱分析	全部A股	3.50	-2.70↓	技术面	2.60	-2.70↓
	资金面	4.40	-2.60↓			
行业消息	<p>1、7月5日上午, 中共中央政治局委员、国务院副总理、中美全面经济对话中方牵头人刘鹤应约与美财政部长耶伦举行视频通话。双方就宏观经济形势、全球产业链供应链稳定等议题务实、坦诚交换了意见, 交流富有建设性。双方认为, 当前世界经济面临严峻挑战, 加强中美宏观政策沟通协调意义重大, 共同维护全球产业链供应链稳定, 有利于中美两国和整个世界。中方表达了对美国取消对华加征关税和制裁、公平对待中国企业等问题的关切。双方同意继续保持对话沟通。</p>				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	<p>A股主要指数走势分化。沪深早盘下探, 走出W形势, 尾盘跌幅收窄。创业板指亦小幅收跌。三期指中仅上证50收于平盘上方, 沪深300以及中证500均走弱。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 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>					