

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 (2206)	4248.8	-60.4↓	IF次主力合约 (2206)	4211.4	-62.0↓
	IH主力合约 (2206)	2888.6	-51.8↓	IH次主力合约 (2206)	2857.2	-52.0↓
	IC主力合约 (2206)	6253.6	-54.8↓	IC次主力合约 (2206)	6211.6	-49.8↓
	IF-IH当月合约价差	1360.2	+3.4↑	IC-IF当月合约价差	2004.8	+30.6↑
				IC-IH当月合约价差	3365.0	+34.0↑
	IF当季-当月	-64.6	-3.2↓	IF下季-当月	-79.8	-1.4↓
	IH当季-当月	-42.6	-3.6↓	IH下季-当月	-35.8	+2.2↑
	IC当季-当月	-127.6	+1.6↑	IC下季-当月	-242.2	-1.6↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-26670	-5139.0↓	IH前20名净持仓	-20,900	-2324.0↓
	IC前20名净持仓	-16526	-2597.0↓			
现货价格	沪深300	4250.06	-28.2↓	IF主力合约基差	-1.3	-28.6↓
	上证50	2891.34	-32.7↓	IH主力合约基差	-2.7	-32.0↓
	中证500	6264.82	+3.8↑	IC主力合约基差	-11.2	+2.0↑
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,805.90	-2181.51↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,534.81	+55.53↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+133.59	+44.52↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+100
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+93.36	-388.27↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)	0	
	上涨股票比例 (日, %)	62.08	+18.53↑	Shibor (日, %)	1.413	0.00
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2206)	23.80	-56.40↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	21.75	-2.42↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2206)	24.80	+2.20↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	22.85	+4.69↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.45	+0.20↑	成交量PCR (%)	87.70	+20.56↑
Wind市场强弱分析	全部A股	5.60	+0.10↑	持仓量PCR (%)	117.86	-8.65↓
	资金面	5.00	-1.70↓	技术面	6.20	+1.80↑
行业消息	1国家统计局网站6月16日信息显示, 中国5月70大中城市中有25城新建商品住宅价格环比上涨, 4月为18城; 环比看, 成都涨幅0.9%领跑, 北上广深分别涨0.4%、持平、涨0.5%、涨0.5%。				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数涨跌不一。沪指早盘以震荡为主, 午后下行失守3300点。创业板指全天于平盘上方震荡, 尾盘涨幅有所收窄。三期指走势分化, 沪深300以及上证50显著回调, 中证500收平于平盘上方。沪深两市成交额下降, 仍维持在万亿上方。北向资金大幅净流入。市场当前的核心仍在国内经济基本面的修复上, 基本面数据的拐点是指数反转的核心动力。短线上, 板块间热点轮动仍然较快, 资金多空分歧较强, 短期股指延续涨势取决于市场量能能否大幅提升。预计短线指数于3300点压力位附近存在调整倾向, 需密集关注政策面、资金面以及外部环境因素的变化。资产配置层面, 关注稳增长主线、疫后修复主线以及中报业绩较好板块。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	6-16 20: 30 美国6月11日当周首次申请失业救济人数(万人); 美国5月新屋开工(万户); 美国5月营建许可(万户) 6-17 11: 00 日本央行公布利率决议					

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