

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)	4400.4	-41.0↓	IF次主力合约 (2209)	4371.0	-39.0↓
	IH主力合约 (2207)	2975.0	-43.2↓	IH次主力合约 (2209)	2968.2	-41.0↓
	IC主力合约 (2207)	6401.6	-48.2↓	IC次主力合约 (2209)	6323.4	-47.8↓
	IF-IH当月合约价差	1425.4	-4.4↓	IC-IF当月合约价差	2001.2	-15.8↓
				IC-IH当月合约价差	3426.6	-20.2↓
	IF当季-当月	-29.4	+2.8↑	IF下季-当月	-53.8	+4.2↑
	IH当季-当月	-6.8	+2.2↑	IH下季-当月	-4.4	+8.8↑
	IC当季-当月	-78.2	-1.4↓	IC下季-当月	-176.4	+2.6↑
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-14,581.00	+423.0↑	IH前20名净持仓	-18,734	+682.0↑
	IC前20名净持仓	-8,090.00	+1080.0↑			
现货价格	沪深300	4423.97	-65.6↓	IF主力合约基差	-23.6	+35.4↑
	上证50	2996.73	-55.4↓	IH主力合约基差	-21.7	+32.9↑
	中证500	6418.55	-93.0↓	IC主力合约基差	-16.9	+57.9↑
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	10,866.47	-943.37↓	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)	-13.83	-13.48	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-1000	+30
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-483.68	-587.02	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	27.33	-24.67↓	Shibor (日, %)	1.210	-0.157↓
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	66.00	+31.80↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	21.37	-8.50↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	63.00	+21.80↑	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	21.28	+13.70↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	17.78	+1.02↑	成交量PCR (%)	94.22	+9.51↑
				持仓量PCR (%)	103.70	-11.67↓
Wind市场强弱分析	全部A股	3.30	-0.20↓	技术面	2.70	+0.10↑
	资金面	3.90	-0.50↓			
行业消息	1、中汽协: 中国汽车工业协会根据重点企业上报的周报数据推算, 6月, 汽车行业销量预计完成244.7万辆, 环比增长34.4%, 同比增长20.9%; 2022年1-6月, 销量预计完成1200.2万辆, 同比下降7.1%。					 <p>更多观点请咨询!</p>
观点总结	A股主要指数集体收跌。沪深全天低开低走, 尾盘收跌超过1%。创业板指午后走弱, 收跌接近1%。三期指中上证50回调幅度最大, 沪深300以及中证500均走弱。沪深两市呈现缩量下跌的局势。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。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。					 <p>更多资讯请关注!</p>
重点关注	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)					