

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)	4410.6	+47.0↑	IF次主力合约 (2209)	4382.8	+48.8↑
	IH主力合约 (2207)	2982.8	+33.6↑	IH次主力合约 (2209)	2972.6	+35.0↑
	IC主力合约 (2207)	6363.6	+19.2↑	IC次主力合约 (2209)	6281.0	+18.4↑
	IF-IH当月合约价差	1427.8	+10.6↑	IC-IF当月合约价差	1953.0	-29.4↓
				IC-IH当月合约价差	3380.8	-18.8↓
	IF当季-当月	-27.8	+1.6↑	IF下季-当月	-44.6	+3.4↑
	IH当季-当月	-10.2	+0.8↑	IH下季-当月	-15.4	-0.6↓
	IC当季-当月	-82.6	+0.2↑	IC下季-当月	-183.6	-3.6↓
期货持仓头寸 (净多)	IF前20名净持仓	-20,374.00	-1241.0↓	IH前20名净持仓	-20,979	-1553.0↓
	IC前20名净持仓	-9,297.00	-1149.0↓			
现货价格	沪深300	4444.26	+49.5↑	IF主力合约基差	-33.7	-78.1↓
	上证50	3013.95	+39.2↑	IH主力合约基差	-31.2	-65.0↓
	中证500	6407.74	+39.5↑	IC主力合约基差	-44.1	-59.1↓
Wind市场强弱分析	A股成交额 (日, 亿元)	12,286.86	+686.10↑	两融余额 (前一交易日, 亿元)	15,796.39	+0.69↑
	陆股通 (昨日, 今日, 亿元)	+96.17	+72.65↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-100	+1000
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-90.24	-147.42↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	56.83	-6.17↓	Shibor (日, %)	1.438	+0.003↑
沪深300指数期权	IO平值看涨期权收盘价 (2207)	66.00	+19.40↑	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	19.85	+4.26↑
	IO平值看跌期权收盘价 (2207)	105.20	-29.20↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	19.78	+1.43↑
	沪深300指数20日波动率 (%)	15.69	+0.13↑	成交量PCR (%)	72.09	-2.25↓
Wind市场强弱分析	全部A股	6.40	-0.40↓	持仓量PCR (%)	74.34	+13.94↑
	资金面	7.20	-0.10↓	技术面	5.70	-0.50↓
行业消息	1、国家统计局: 1—5月份, 规模以上工业企业中, 国有控股企业实现利润总额11583.7亿元, 同比增长9.8%; 股份制企业实现利润总额25802.5亿元, 增长7.8%; 外商及港澳台商投资企业实现利润总额7845.3亿元, 下降16.1%; 私营企业实现利润总额10070.9亿元, 下降2.2%。				 <p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结	A股主要指数集体收涨。沪指早盘震荡攀升, 创业板指全天波动放大。三期指中涨幅扩大, 沪深300以及上证50收涨超过1%。沪深两市成交额上升, 北向资金呈大幅净流入趋势。国常会提出加大汽车消费的支持政策, 汽车产业链持续走强, 同时进一步拉升了市场整体做多情绪。近期市场大体呈现放量反弹的局面, 新增资金入场, 北向资金流入共同促进了市场流动性。预计本周市场将延续震荡上行的主基调, 建议短线上可把握行情波动下的逢低布局机会, 结合低估值逻辑的前景板块。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股资产将更具备吸引力。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	6-28 20: 30 美国5月商品贸易帐(亿美元); 22: 00 美国6月谘商会消费者信心指数 6-29 20: 30 美国一季度个人消费支出(PCE)年化季环比终值; 美国一季度实际GDP年化季环比终值 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					

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