

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 (2506)	3824.8	+4.2↑	IF次主力合约 (2509)	3751.8	+1.4↑
	IH主力合约 (2506)	2668.6	+1.4↑	IH次主力合约 (2509)	2632.8	+2.4↑
	IC主力合约 (2506)	5638.4	+18.6↑	IC次主力合约 (2509)	5455.2	+12.0↑
	IM主力合约 (2506)	5998.0	+40.6↑	IM次主力合约 (2509)	5745.0	+34.6↑
	IF-IH当月合约价差	1156.2	+1.0↑	IC-IF当月合约价差	1813.6	+8.2↑
	IM-IC当月合约价差	359.6	+21.4↑	IC-IH当月合约价差	2969.8	+9.2↑
	IM-IF当月合约价差	2173.2	+29.6↑	IM-IH当月合约价差	3329.4	+30.6↑
	IF当季-当月	-73.0	-2.6↓	IF下季-当月	-108.8	-1.6↓
	IH当季-当月	-35.8	+1.8↑	IH下季-当月	-35	+3.8↑
	IC当季-当月	-183.2	-7.4↓	IC下季-当月	-309.6	-14.2↓
	IM当季-当月	-253.0	-6.8↓	IM下季-当月	-428.8	-14.0↓
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-28,697.00	-138.0↓	IH前20名净持仓	-11,498.00	+686.0↑
	IC前20名净持仓	-11,705.00	+1088.0↑	IM前20名净持仓	-30,786.00	-1498.0↓
现货价格	沪深300	3852.01	+11.8↑	IF主力合约基差	-27.2	-9.4↓
	上证50	2687.30	+8.6↑	IH主力合约基差	-18.7	-7.2↓
	中证500	5694.84	+23.8↑	IC主力合约基差	-56.4	-13.2↓
	中证1000	6070.04	+43.5↑	IM主力合约基差	-72.0	-11.5↓
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	11,638.30	-4.16↓	两融余额 (前一交易日, 亿元)	18,009.47	-84.23↓
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	1526.22	+147.72↑	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-8300.0	+4545.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-496.74	-95.94↓	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	62.64	+42.00↑	Shibor (日, %)	1.410	-0.061↓
	IO平值看涨期权收盘价 (2506)	32.20	-3.00↓	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	12.22	-0.94↓
	IO平值看跌期权收盘价 (2506)	56.40	-5.80↓	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	12.22	-0.39↓
	沪深300指数20日波动率 (%)	10.03	0.00	成交量PCR (%)	73.90	+2.64↑
				持仓量PCR (%)	66.26	-1.13↓
Wind市场强弱分析	全部A股	6.50	+3.40↑	技术面	6.30	+4.30↑
	资金面	6.70	+2.60↑			

行业消息

1、国家统计局公布数据显示, 5月我国制造业PMI为49.5%, 环比升0.5个百分点。非制造业PMI为50.3%, 环比降0.1个百分点。综合PMI为50.4%, 环比升0.2个百分点。新出口订单指数和进口指数分别为47.5%和47.1%, 环比升2.8和3.7个百分点。

2、美国总统特朗普在宾夕法尼亚州举行的一场集会上表示, 将把进口钢铁的关税从25%提高至50%, 该决定从6月4日起生效。

3、美国贸易代表办公室宣布, 延长对中国在技术转让、知识产权和创新方面的行为、政策及做法的301调查中的豁免期限。豁免期限原定于5月31日到期, 现已延长至8月31日。

4、美方称中方违反中美日内瓦经贸会谈共识, 商务部新闻发言人就上述有关言论答记者问指出, 中方维护权益是坚定的, 落实共识是诚信的。美单方面不断挑起新的经贸摩擦, 加剧双边经贸关系的不确定性、不稳定性, 不仅不反思自身, 反而倒打一耙, 无端指责中方违反共识, 这严重背离事实。中方坚决拒绝无理指责。中方敦促美方与中方相向而行, 立即纠正有关错误做法, 共同维护日内瓦经贸会谈共识。



更多观点请咨询!

观点总结

A股主要指数集体收涨。三大指数低开高走。中小盘股略强于大盘蓝筹股。截止收盘, 上证指数指涨0.43%, 深证成指涨0.16%, 创业板指涨0.48%。沪深两市成交额微幅减少。全市场近3400只个股上涨。行业板块多数上涨, 美容护理、纺织服装板块大幅走强, 家用电器板块领跌。海外方面, 6月1日美国贸易代表办公室延长针对中国301调查的豁免期限, 对贸易紧张局势有一定缓和。然而6月2日, 美方称中方违反中美日内瓦经贸会谈共识, 又增加了贸易局势反复变化的隐忧, 市场仍面临着极大的不确定性。国内方面, 经济基本面, 5月我国制造业PMI为49.5%, 较上月小幅回升。其中新出口订单指数和进口指数分别为47.5%和47.1%, 较上月上升明显。在中美关税争端缓和后, 进出口情况有所改善。整体来看, 国内5月份制造业PMI虽有所回升但仍处于荣枯线下方, 加上海外关税扰动仍未结束, 市场做多热情受到压制, 指数目前处于4月3日市场跳空下跌前的缺口附近震荡, 上方仍面临较大压力, 在国内宏观支持政策相继出台后, 市场目前处于政策真空期, 短期市场暂时或缺乏明显主线, 且预计维持震荡态势。策略上, 建议暂时观望。



更多资讯请关注!

重点关注	6/3 17:00 欧元区5月HCPI、核心HCPI 6/3 22:00 美国4月JOLTs职位空缺 6/4 20:15 美国5月ADP就业人数 6/4 21:45 加拿大央行利率决议 6/5 19:30 美国5月挑战者企业裁员人数 6/5 20:15 欧洲央行利率决议 6/6 20:30 美国5月非农就业数据、失业率、劳动参与率
------	--

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 IM：中证1000 IO:沪深300期权

研究员: 廖宏斌
期货从业资格号F30825507 期货投资咨询从业证书号Z0020723
微信号: yanjiufuwu
电话: 0595-86778969

免责声明：本报告中的信息均来源于公开可获得资料，瑞达期货股份有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

