

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)	3842.4	+15.61	IF次主力合约 (2509)	3769.4	+13.81
	IH主力合约 (2506)	2673.6	+4.21	IH次主力合约 (2509)	2637.4	+4.01
	IC主力合约 (2506)	5688.8	+42.81	IC次主力合约 (2509)	5500.4	+37.61
	IM主力合约 (2506)	6054.0	+49.21	IM次主力合约 (2509)	5796.6	+44.81
	IF-IH当月合约价差	1168.8	+12.61	IC-IF当月合约价差	1846.4	+32.81
	IM-IC当月合约价差	365.2	+5.61	IC-IH当月合约价差	3015.2	+45.41
	IM-IF当月合约价差	2211.6	+38.41	IM-IH当月合约价差	3380.4	+51.01
	IF当季-当月	-73.0	0.0	IF下季-当月	-112.2	-3.41
	IH当季-当月	-36.2	-0.41	IH下季-当月	-36	-1.01
	IC当季-当月	-188.4	-5.21	IC下季-当月	-317.2	-7.61
IM当季-当月	-257.4	-4.41	IM下季-当月	-438	-9.21	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	-29,186.00	-347.01	IH前20名净持仓	-11,680.00	+666.01
	IC前20名净持仓	-9,405.00	-497.01	IM前20名净持仓	-28,229.00	-1019.01
现货价格	沪深300	3868.74	+16.71	IF主力合约基差	-26.3	+0.91
	上证50	2690.82	+3.51	IH主力合约基差	-17.2	+1.51
	中证500	5739.01	+44.21	IC主力合约基差	-50.2	+6.21
	中证1000	6123.17	+53.11	IM主力合约基差	-69.2	+2.91
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	11,774.13	+135.831	两融余额 (前一交易日, 亿元)	18,044.88	+35.421
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	1575.45	+49.241	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-2155.0	+2149.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	-95.94	+1.37	MLF (续作量, 净投放, 亿元)		
	上涨股票比例 (日, %)	72.91	+10.271	Shibor (日, %)	1.408	-0.0021
Wind市场强弱分析	IO平值看涨期权收盘价 (2506)	38.60	+6.401	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	12.19	-0.031
	IO平值看跌期权收盘价 (2506)	44.60	-11.801	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	12.19	-0.031
	沪深300指数20日波动率 (%)	9.57	-0.461	成交量PCR (%)	55.25	-18.651
	全部A股资金面	7.10	+0.601	持仓量PCR (%)	66.57	+0.311
	技术面	7.30	+1.101			

行业消息	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	 <p>更多观点请咨询!</p>
观点总结	<p>A股主要指数集体收涨。三大指数早盘高开高走, 午后维持震荡。中小盘股强于大盘蓝筹股。截止收盘, 上证指数指涨0.42%, 深证成指涨0.87%, 创业板指涨1.11%。沪深两市成交额小幅增加。全市场近4000只个股上涨。行业板块普遍上涨, 美容护理、综合、纺织服饰板块大幅走强。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, 加上海关关税扰动仍未结束, 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。</p>	 <p>更多资讯请关注!</p>

重点关注

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。

瑞达研究