

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 (2606)	4852.6	+54.01	IF次主力合约 (2609)	4765.2	+50.01
	IH主力合约 (2606)	2943.2	+38.61	IH次主力合约 (2609)	2899.2	+31.41
	IC主力合约 (2606)	8582.8	+89.81	IC次主力合约 (2609)	8405.0	+78.21
	IM主力合约 (2606)	8661.4	+52.41	IM次主力合约 (2609)	8434.6	+45.81
	IF-IH当月合约价差	1909.4	+20.41	IC-IF当月合约价差	3730.2	+49.21
	IM-IC当月合约价差	78.6	-42.01	IC-IH当月合约价差	5639.6	+69.61
	IM-IF当月合约价差	3808.8	+7.21	IM-IH当月合约价差	5718.2	+27.61
	IF当季-当月	-87.4	-6.01	IF下季-当月	-142.4	-7.21
	IH当季-当月	-44.0	-7.21	IH下季-当月	-61.2	-7.61
	IC当季-当月	-177.8	-14.01	IC下季-当月	-331.2	-13.61
IM当季-当月	-226.8	-7.41	IM下季-当月	-438.4	-8.61	
期货持仓头寸	IF前20名净持仓	27,233.00	-273.01	IH前20名净持仓	20,759.00	-951.01
	IC前20名净持仓	33,396.00	-2314.01	IM前20名净持仓	57,113.00	+173.01
现货价格	沪深300	4921.60	+76.51	IF主力合约基差	-69.0	-12.11
	上证50	2,968.7	+45.21	IH主力合约基差	-25.5	-1.21
	中证500	8,703.9	+127.01	IC主力合约基差	-121.1	-13.41
	中证1000	8,799.3	+106.71	IM主力合约基差	-137.9	-35.01
市场情绪	A股成交额 (日, 亿元)	32,269.52	+3022.931	两融余额 (前一交易日, 亿元)	28,991.52	+29.411
	北向成交合计 (前一交易日, 亿元)	3325.77	-679.091	逆回购 (到期量, 操作量, 亿元)	-10.0	+2580.0
	主力资金 (昨日, 今日, 亿元)	+388.40	-156.351	MLF (续作量, 净投放, 亿元)	6000	+1000
	上涨股票比例 (日, %)	39.55	-30.561	Shibor (日, %)	1.327	+0.0031
期权市场	IO平值看涨期权收盘价 (2606)	68.60	+20.801	IO平值看涨期权隐含波动率 (%)	16.00	-0.441
	IO平值看跌期权收盘价 (2606)	107.40	-47.001	IO平值看跌期权隐含波动率 (%)	15.75	-0.751
	沪深300指数20日波动率 (%)	15.23	+0.791	成交量PCR (%)	59.30	-17.911
				持仓量PCR (%)	79.06	+1.411

行业消息

1、美联储理事沃勒表示，对于美联储下一步利率行动，加息的可能性与降息相当。如果通胀不能很快开始放缓，他不排除未来加息的可能；他还表示将支持从政策声明中删除“宽松倾向”的措辞。沃勒警告称，如果通胀预期开始失去锚定，他将毫不犹豫地支持加息。

2、美国总统特朗普表示，美国与伊朗已经基本谈成一份协议，协议的最后环节与细节目前正在商讨中，将于近期公布。特朗普称，谈判正在有序且建设性地进行，已通知代表们不要急于达成协议。值得注意的是，美伊双方对同一份备忘录描述出现分歧：美国坚称伊朗须交出440公斤高浓缩铀，伊朗断然否认，称核问题根本未被提及。消息人士透露，美国与伊朗新一轮会谈可能在6月5日举行。



更多观点请咨询！

观点总结

A股主要指数收盘集体普遍上涨，三大指数高开高走。大盘蓝筹股略强于中小盘股。截止收盘，上证指数涨0.96%，深证成指涨1.66%，创业板指涨2.1%。沪深两市成交额显著回升。行业板块涨跌不一，电子、通信等板块大幅走强，石油石化板块领跌。海外方面，地缘局势上，周末期间，美国媒体表示，伊朗已同意放弃其拥有的高浓缩铀库存，同时美伊双方将停火延长60天，期间霍尔木兹海峡将重新开放。海峡重新开放的消息，使得国际油价今日大幅下跌，10年期美债收益率跌破4.5%。但今日早间，伊朗称现阶段伊尚未就核问题的细节做出任何承诺。双方在核问题上出现严重的信息分歧。货币政策上，周六晚间，美联储理事沃勒发表鹰派讲话，表示将支持从政策声明中删除“宽松倾向”的措辞，同时若通胀持续上升将支持加息。国内方面，经济基本面，4月份，除进出口外，国内规上工业增加值、固投、社零均较上月回落，但从细分项看，新质生产力相关产业依旧保持较高增速，且部分指标仍有小幅上升。整体来看，海外地缘冲突谈判取得一定突破，但双方在最核心问题上仍有严重分歧。但市场对于海峡恢复通航的乐观情绪，盖过了对伊朗浓缩铀去向不确定性的担忧，美债收益率下行且跌破关键点位，支撑权益市场反弹。同时，新质生产力对经济的支撑预计使得相关行业股价有较好表现，A股科技板块有望跟随全球行业趋势上涨。



更多资讯请关注！

重点关注

5/27 9:30 中国4月规上工业企业利润  
5/28 20:30 美国4月PCE、核心PCE  
5/31 9:30 中国5月官方制造业、非制造业、综合PMI

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，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