

金融期货

【观点和操作建议】

宏观: 国际方面, 美国 5 月 PPI 同比升 6.6%, 预期升 6.3%, 前值升 6.2%; 美国 5 月工业产出环比升 0.8%, 预期升 0.6%; 美国 5 月零售销售环比降 1.3%, 预期降 0.7%, 前值持平。国内方面, 5 月份经济持续稳定恢复, 全社会用电量持续快速增长, 达到 6724 亿千瓦时, 同比增长 12.5%, 较 2019 年同期增长 18.7%。

股指: 周二股指期货下跌。盘面上, 大盘放量杀跌, 两市成交 10005 亿, 北上资金净卖出 51.5 亿。板块上, MINILED、超清视频、通用航空涨幅居前, 鸿蒙概念、稀缺资源、猪肉养殖下跌。国内经济形势稳健、消费复苏, 建议多单离场观望, IF2106 多单 4916.4 止损、IH2106 多单 3362 止损、IC2106 多单 6332 止损。

国债: 周二国债期货下跌。现券收益率小幅波动, 资金面整体平稳。MLF 等量续做, 政策继续释放坚定维稳信号。市场情绪整体偏弱, 央行态度及流动性变化是 6 月份的主要关注因素。整体判断弱势震荡行情, 建议逢高做空, TS2109 空单 100.61 止损、TF2109 空单 100.415 止损、T 空单 98.695 止损。

一、行情回顾

图表1: 当日行情总结

主力合约	收盘价	涨跌 (%)	成交量	持仓量	日增仓
IF2106	5,157.2	-1.26%	94,147	94,471	-10,753
IH2106	3,521.8	-1.39%	38,563	40,107	-3,126
IC2106	6,652.4	-1.06%	57,981	69,471	-9,633
TS2109	100.190	0.01%	5,906	29,428	532
TF2109	99.700	0.04%	21,219	58,392	213

2021. 6. 16

T2109	97.760	0.07%	54,615	133,986	1,430
--------------	--------	-------	--------	---------	-------

数据来源：文华财经、国元期货

二、现货市场

【现货行情走势】

主要指数	收盘价	成交额(亿元)	日涨跌点	日涨跌幅
上证综指	3,557	4,447	-33.2	-0.92%
深证成指	14,673	5,558	-127.9	-0.86%
创业板	3,262	2,247	-36.3	-1.10%
沪深 300	5,167	3,306	-58.1	-1.11%
上证 50	3,529	1,029	-48.1	-1.35%
中证 500	6,664	1,664	-62.3	-0.93%

数据来源：文华财经、国元期货

【银行间国债到期收益率】

期限	利率(%)	涨跌(bp)
3M	1.86	-4.7
1Y	2.47	2.4
2Y	2.75	0.1
3Y	2.85	-0.2
5Y	3.00	-0.4
7Y	3.12	-1.0
10Y	3.12	-1.0
30Y	3.66	-0.2

数据来源：中国债券网、国元期货

【货币市场利率】

期限	利率(%)	涨跌(bp)
FR001	2.12	10.0
FR007	2.24	8.9
FR014	2.25	0.0
Shibor O/N	2.10	10.6
Shibor 1W	2.24	6.8
Shibor 2W	2.25	4.4
R001	2.13	10.2

R007	2.26	14.3
------	------	------

数据来源：中国货币网、国元期货

三、信息资讯

1、财政部下达 2021 年普惠金融发展专项资金 44.67 亿元，加上 2020 年底提前下达的 47.48 亿元，2021 年度专项资金 92.15 亿元已全部下达，较上年增长 31.2%。

2、沪深交易所首批基础设施公募 REITs 将于 6 月 21 日正式上市，标志着国内公募 REITs 试点工作即将正式落地。公募 REITs 上市首日价格涨跌幅限制比例为 $\pm 30\%$ ，非上市首日涨跌幅限制比例为 $\pm 10\%$ 。

3、首批 9 只科创创业 50ETF 获批，包括华夏、易方达、南方、嘉实、招商、银华、国泰、富国、华宝等 9 家基金公司旗下基金。这意味着投资者即将拥有在场内一键布局创业板、科创板龙头公司的工具型利器。据悉，首批双创 50ETF 或同步定档 6 月 21 日发行。

4、央行周二开展 2000 亿元 1 年期中期借贷便利（MLF）操作（含对 6 月 15 日 MLF 到期的续做）和 100 亿元 7 天期逆回购操作，当日有 200 亿元逆回购和 2000 亿元 MLF 到期。Shibor 短端品种多数上行，隔夜品种上行 10.6bp 报 2.104%。

5、中基协：截至 5 月末，存续私募基金管理人 24427 家，环比减少 0.21%；管理基金数量增长 1.26% 至 106345 只；管理基金规模增长 0.20% 至 17.82 万亿元。

6、美联储周二（6 月 15 日）逆回购工具使用规模为 5096 亿美元，连续五个交易日超过 5000 亿美元；周一曾以 5839 亿美元创历史新高。

重要声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，国元期货力求准确可靠，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，也没有考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。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。

联系我们 全国统一客服电话：400-8888-218

国元期货总部

地址：北京东城区东直门外大街 46 号天恒大厦 B 座 21 层

电话：010-84555000

合肥分公司

地址：合肥市蜀山区金寨路 91 号立基大厦 A 座六楼（中国科技大学金寨路大门斜对面）

电话：0551-62895501

福建分公司

地址：福建省厦门市思明区莲岳路 1 号 2204 室之 01 室（即磐基商务楼 2501 室）

电话：0592-5312522

大连分公司

地址：大连市沙河口区会展路 129 号国际金融中心 A 座期货大厦 2407、2406B。

电话：0411-84807840

西安分公司

地址：陕西省西安市雁塔区二环南路西段 64 号凯德广场西塔 6 层 06 室

电话：029-88604088

上海分公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄 1 号楼 3 层 C 区

电话：021-68400292

合肥营业部

地址：合肥市庐阳区国轩凯旋大厦四层（合肥师范学院旁）

电话：0551-68115906、0551-68115888

郑州营业部

地址：郑州市金水区未来路 69 号未来大厦 1410 室

电话：0371-53386892/53386809

青岛营业部

地址：青岛市崂山区秦岭路 15 号 1103 室

电话 0532-66728681

深圳营业部

地址：深圳市福田区园岭街道百花二路 48 号二层（深圳实验小学对面）

电话：0755-82891269

杭州营业部

地址：浙江省杭州市滨江区江汉路 1785 号网新双城大厦 4 幢 2201-3 室

电话：0571-87686300

通辽营业部

地址：内蒙古通辽市科尔沁区建国路 37 号世基大厦 12 层

电话：0475-6380818