

三大指数回落 创指跌破 4000 点

证券研究报告——市场日报

行情回顾

2026.06.05

(预计发布时间: 2026.06.08)

大同证券研究中心

分析师: 景剑文

执业证书编号: S0770523090001

邮箱: jingjw@dtsbc.com.cn

地址: 山西太原长治路 111 号山西世贸中心
A 座 F12、F13网址: <http://www.dtsbc.com.cn>

周五(6月5日),三大指数早盘低开,之后震荡拉升,短暂冲高后震荡回落,午后跌幅扩大,尾盘悉数回落,创指收跌逾3%,跌破4000点。截至收盘,上证指数(-0.74%)收跌4027.74点,深证成指(-2.21%)收涨15314.70点,创业板指(-3.20%)收涨3957.94点,两市量能小幅拉升,突破3万亿。申万一级行业多数下跌,银行、商贸零售、社会服务领涨,电子、公用事业、通信领跌。

风险提示

热门板块突发利空引发市场扰动

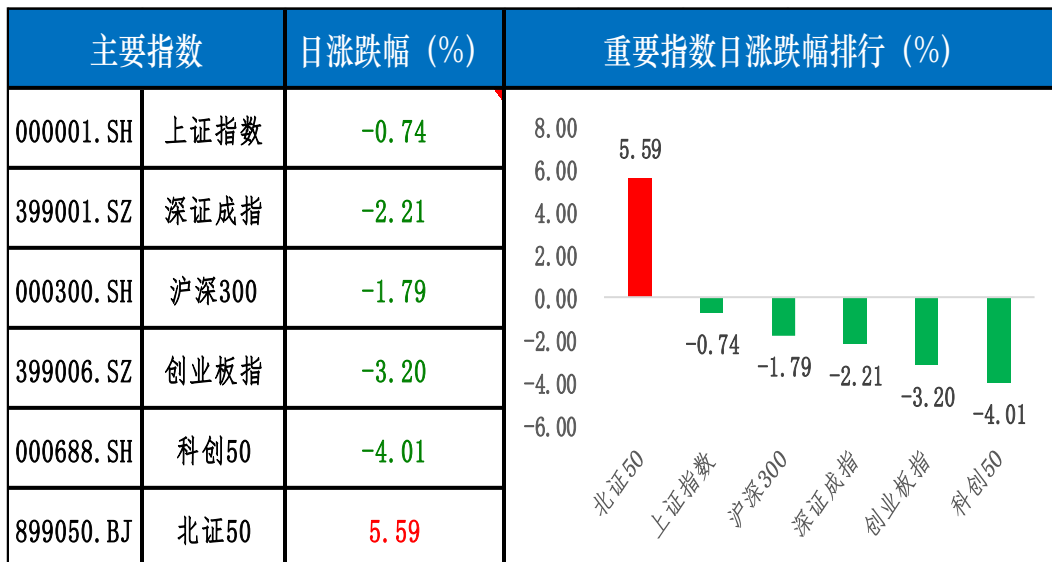
当日要闻

国办:对私募证券投资基金加大监测力度 强化交易行为监管。国务院办公厅发布关于加强监管防范风险促进私募投资基金高质量发展的指导意见。意见指出,细化私募基金风险评价标准,提升监管强度与风险水平适配性,按照评价结果对不同私募基金管理人实施差异化监管。对重点私募基金管理人依法加大现场检查力度,加强央地和跨辖区联合检查。对异地经营的私募基金管理人加大监管力度,引导注册地与经营地相统一。对存在违规代持、通道化等情形的私募基金管理人加大规范引导力度,推动主动整改。对私募证券投资基金加大监测力度,强化交易行为监管。(消息来源:东方财富)

外交部回应中欧“贸易平衡”问题:望欧方能恪守市场经济基本原则。6月5日,外交部发言人毛宁主持例行记者会。彭博社记者提问,欧盟贸易代表已向中方提出,要求解决中国“不可持续”的贸易平衡问题。发言人能否进一步介绍迄今为止中欧双方讨论了哪些内容,以及中方对于欧盟可能针对中国贸易做法采取措施有何关切?“具体问题你可以向主管部门了解。”毛宁表示,最近我们也多次就中欧经贸关系介绍中方的立场,我们认为中欧经贸关系本质是互利共赢的,中方从不刻意追求贸易顺差。我们也注意到欧方有关对华的表态,正在密切关注欧方的动向。毛宁强调,我们愿意同欧方进行对话沟通,希望欧方能够恪守自由贸易、公平竞争、开放合作等市场经济的基本原则,避免保护主义措施,坚持通过对话协商处理分歧,解决彼此的关切。(消息来源:东方财富)

■ 指数表现

图表 1 重要指数日涨跌幅 (%) (2026. 6. 5)



数据来源: Wind 大同证券研究中心

■ 市场表现

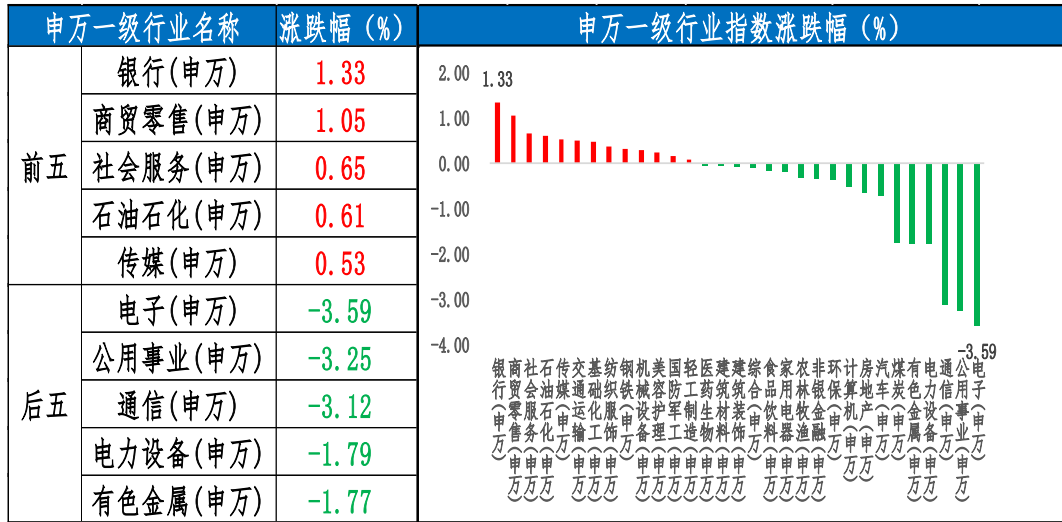
图表 2 市场日度综合表现 (2026. 6. 5)

分类	指标	数据	单位
市场强弱 (沪深京)	上涨家数	3,277	只
	平盘家数	135	只
	下跌家数	2,113	只
赚钱效应 (沪深京)	涨停家数	88	只
	跌停家数	18	只
	上涨家数占比	58.20	%
成交情况 (沪深)	两市成交量	1,481.17	亿股
	两市成交额	30,691.92	亿元

数据来源: Wind 大同证券研究中心

■ 板块表现

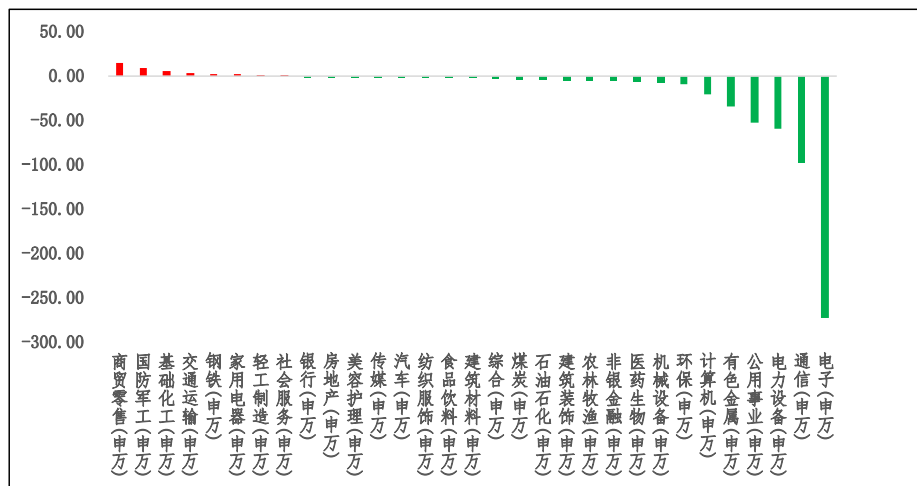
图表 3 申万 I 级行业日涨跌幅情况 (%) (2026. 6. 5)



数据来源: Wind 大同证券研究中心

■ 资金表现

图表 4 申万 I 级行业日主力资金净流入 (亿元) (2026. 6. 5)



数据来源: Wind 大同证券研究中心

大同证券投资评级的类别、级别定义：

类别	级别	定义
股票评级	强烈推荐	预计未来 6~12 个月内，股价表现优于市场基准指数 20% 以上
	谨慎推荐	预计未来 6~12 个月内，股价表现优于市场基准指数 10%~20%
	中性	预计未来 6~12 个月内，股价波动相对市场基准指数-10%~+10%
	回避	预计未来 6~12 个月内，股价表现弱于市场基准指数 10% 以上
	“+”表示市场表现好于基准，“-”表示市场表现落后基准	

类别	级别	定义
行业评级	看好	预计未来 6~12 个月内，行业指数表现强于市场基准指数
	中性	预计未来 6~12 个月内，行业指数表现跟随市场基准指数
	看淡	预计未来 6~12 个月内，行业指数表现弱于市场基准指数

注 1：公司所处行业以交易所公告信息为准

注 2：行业指数以交易所发布的行业指数为主

注 3：基准指数为沪深 300 指数

分析师声明：

作者具有中国证券业协会授予的证券投资咨询执业资格并注册为注册分析师，本报告准确客观反映了作者本人的研究观点，结论不受第三方授意或影响。在研究人员所知情的范围内本公司、作者以及财产上的利害关系人与所评价或推荐的证券不存在利害关系。

本报告采用的研究方法均为定性、定量相结合的方法，本报告所依据的相关资料及数据均为市场公开信息及资料（包括但不限于：Wind/同花顺 iFinD/国家统计局/公司官网等），做出的研究结论与判断仅代表报告发布日前的观点，具备一定局限性。

免责声明：

本报告由大同证券有限责任公司（已具备中国证监会批复的证券投资咨询业务资格）制作。本报告所载资料的来源及观点皆为公开信息，但大同证券不能保证其准确性和完整性，因此大同证券不对因使用此报告的所载资料而引致的损失负任何责任。

本报告所载的意见、评估及预测仅为本报告出具日的观点和判断。本公司不保证文中观点或陈述不会发生任何变更，在不同时期，本公司可发出与本报告所载资料、意见及推测不一致的报告。

市场有风险，投资需谨慎。此报告仅做参考，并不能依靠此报告以取代独立判断。本报告仅反映研究员的不同设想，见解及分析方法，并不代表大同证券有限责任公司。

《证券期货投资者适当性管理办法》于 2017 年 7 月 1 日起正式实施，本报告仅供本公司签约客户使用，若您并非本公司签约客户，为控制投资风险，请取消接收、订阅或使用本报告中的任何信息。本公司也不会因接收人收到、阅读或关注自媒体推送本报告中的内容而视其为客户。

特别提示:

- 1、投资者应自主做出投资决策并自行承担投资风险，任何形式的分享证券投资收益或者分担证券投资损失的书面或口头承诺均为无效。
- 2、未经允许投资者不得将证券研究报告转发给他人。
- 3、投资者需慎重使用公众媒体刊载的证券研究报告。
- 4、本报告预计发布时间可能会受流程等因素影响而延迟，但最大延迟不会超一周。

版权声明:

本报告版权为大同证券有限责任公司所有，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。如引用需注明出处为大同证券研究中心，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

分析师承诺:

本人、本人配偶及本人的利害关系人与报告内容所涉标的公司不涉及利益冲突。