

## 宏观金融日报 201029

### 内盘股指期货

#### 一、行情回顾

两市股指低开高走，家电、汽车、白酒板块引领市场，美的集团收涨近 6%创新高，老板电器、海信家电涨停，五粮液收涨超 4%报 250 元，泸州老窖收于涨停。疫苗、新冠肺炎检测板块并驾齐驱，华大基因、智飞生物分别涨超 14%、10%。上证指数午后一度突破 20 日均线。尾盘比亚迪炸板，银行股小幅跳水，两市股指回吐部分涨幅，但仍红盘报收。上证指数收升 0.11%，连续三日报得小涨；创业板指涨 1.1%，连涨四日。比亚迪午后一度封板，收涨 4.47%，成交额达百亿元。九号公司收涨 103%。上证 50 收于 3324.44 点，沪深 300 收于 4772.92 点，中证 500 收于 6255.19 点。

#### 二、行情分析

今日早评中我们说：“昨日 A 股连续第二个交易日收高，在各界期望经济进一步走出疫情复苏的情形下，消费及医药类股上涨。在白马股业绩暴雷后，近期白马股有所回暖，但是欧美疫情形势严峻。法国总统马克龙宣布，包括海外领土在内，法国全境从 10 月 30 日起再度封城，以应对新冠肺炎疫情的迅猛反弹，压制市场风险偏好，欧美股市出现大跌，今日 A 股预计小幅回落。”实际走势来看股指走势比预期强，低开高走，消费与汽车再度领涨。法德紧急宣布全国封锁措施，采取封锁措施后新增病例有望在一个月内见顶回落，后续疫情对市场的冲击有望减小。本次疫情主要在欧美爆发，亚太地区没有二次爆发，对经济的影响较 3 月份小，国内经济稳步复苏，A 股走势具有韧性，将震荡企稳。

### 国债期货

#### 一、行情回顾

今日 5 年期国债期货主力合约 TF2012 报收于 99.815，跌幅 0.03%，最高 100.005，最低 99.770，成交量 2.26 万手，持仓量 5.5 万手，日减仓 905 手；10 年期国债期货主力合约 T2012 报收于 98.030，跌幅 0.06%，最高 98.285，最低 97.985，

成交量6万手,持仓量10.8万手,日减仓4024手;2年期国债期货主力合约TS2012报收于100.245,跌幅0.02%,最高100.330,最低100.225,成交量7208手,持仓量2.56万手,日减仓269手。

公开市场有500亿元逆回购到期,央行开展1400亿元7D逆回购操作,净投放900亿元。欧洲主要国家新增病例迭创新高,法德均推出严厉的封锁措施,疫情和经济担忧导致隔夜美欧股市重挫。今日期债早盘高开,但是震荡走弱,多数合约收跌。第十九届中央委员会第五次全体会议今天闭幕,预计将发布“十四五”规划,关注会议传递出来的信息。期债行情波折,市场保持着谨慎。

## 二、重要经济资讯

1. Shibor 隔夜品种大幅下行 25.4bp 报 2.125%, 7 天期下行 3.2bp 报 2.353%, 14 天期上行 0.6bp 报 2.852%, 1 个月期上行 0.4bp 报 2.69%。
2. 国开行 1 年、10 年期固息增发债中标收益率分别为 2.6809%、3.6295%, 投标倍数分别为 6.21、3.69。

分析师:

张惠乾

电话: 025-52278932

从业资格证: F3036196

投资咨询证: Z0014677

史珂

从业资格证号: F3007722

投资咨询证号: Z0015049

## **免责声明/Declaration**

本报告中的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生变更。我们已力求报告内容的客观和公正，但文中的观点和建议仅供参考客户应审慎考量本身需求。我公司及其雇员对使用本报告及其内容所引发的任何直接或间接损失概不负责。本报告版权归弘业期货所有，未经书面许可，任何机构和个人不得翻版、复制和发布；如引用、刊发需注明出处为弘业期货，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

Copyright 2008 Holly Futures Co. Corp.

Holly Daily Information is made available as a complimentary service by Holly Futures Co. No further redistribution is permitted without written permission from Holly Futures Co. Holly Daily Information is intended to provide factual information, but its accuracy cannot be guaranteed. The views expressed in any article are solely those of the respective individuals cited.