

宏观金融日报 201030

内盘股指期货

一、行情回顾

两市股指早盘窄幅整理，半导体、汽车板块大涨力撑大市，午后券商、苹果板块等连续杀跌，海外市场等多重负面来袭，指数一路下滑并全绿报收，超百股跌超9%。兆易创新涨停，韦尔股份涨超7%，半导体板块录涨超1%，连涨五日。比亚迪午后一度涨近8%，收升0.9%，江铃汽车、东风汽车炸板。苹果板块跌4%，环旭电子、安洁科技跌停，立讯精密、歌尔股份跌超6%，蓝思科技跌近9%。券商股全线下滑，中银证券、太平洋跌超7%。上证50收于3280.38点，沪深300收于4695.33点，中证500收于6111.48点。

二、行情分析

今日早评中我们说：“昨日A股放量拉升，汽车及消费类板块受资金青睐，涨逾2%，北上资金及两融资金亦开始小幅加仓。国内经济稳步复苏，A股在外围股指大跌的情况下，具有一定的韧性，股指将震荡企稳。关注今日公布的10月官方制造业PMI，市场预期微降至51.3，经济延续改善势头。”实际走势来看A股上午震荡，午后跟随美股股指期货快速下行，市场在下跌中成交量放大，北向资金再度大幅流出，市场观望气氛浓厚。伊利股份和顺鑫农业等白马股业绩不及预期，带动消费板块整体下跌，苹果财报显示iPhone销售不及预期，苹果产业链个股也出现大跌。十四五规划无超预期利好，股指难以走出独立行情，将弱势震荡，等待外围扰动结束。

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 700 亿元逆回购到期，央行开展 1000 亿元 7 天期逆回购操作。月末最后一天，资金面偏紧，供给短缺状况仍未见明显缓和，主要回购利率多数上行。本周公开市场有 3200 亿元逆回购到期，累计进行了 5100 亿元逆回购操作，周一进行了 500 亿元国库现金定存操作，因此本周央行公开市场宽口径净投放 2400 亿元。下周（10 月 31 日至 11 月 6 日）央行公开市场有 5100 亿元逆回购到期。转债行情明显降温，成交额跌破千亿元。今日期债午后走强，尾盘略有所回落，收盘全线飘红。周末关注即将公布的经济数据。

二、重要经济资讯

1. Shibor 短端品种多数上行。隔夜品种上行 11.1bp 报 2.236%，7 天期上行 6.5bp 报 2.418%，14 天期上行 17.3bp 报 3.025%，1 个月期下行 0.1bp 报 2.689%。
2. 进出口行 1 年期固息新发债中标利率 2.73%，投标倍数 2.9；2 年期固息增发债中标收益率 3.1038%，投标倍数 3.19。

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.