宏观金融日报200930

内盘股指期货

一、行情回顾

两市股指全天缩量整理，光伏、风电、白酒、军工股活跃，券商、煤炭股疲软。上证指数收报3218.05点，跌0.20%，日线五连阴；创业板指报2574.76点，涨0.44%；创业板综指报2952.24点，涨0.35%；深证成指报12907.45点，涨0.05%；科创50报1418.8点，涨2.07%；万得全A报5004.54点，跌0.11%，成交5299亿元，较上日继续小幅缩减。上证50收于3232.42点，沪深300收于4587.40点，中证500收于6192.50点。

二、行情分析

今日早评中我们说：“昨日A股三大指数集体收涨，其中创业板指走势较强，收盘涨幅达到1.67%。市场成交量依然低迷，两市合计成交仅有5450亿元，市场观望情绪浓厚，A股结构性高估与成交量萎缩影响反弹动力，节前股指将继续震荡整理。欧洲多国新冠疫情近来持续反弹，或出台防疫限制措施。假期中外围不确定性因素较大，今日是最后一个交易日，建议观望。”实际走势来看股指如期继续震荡整理，北向资金再度流出，三大股指期货主力合约贴水大幅增加。9月制造业PMI为51.5，较上月上升0.5，超预期。9月官方制造业PMI创半年高点，非制造业PMI创近七年最高位，中国9月经济继续全面恢复。但今日A股走势很弱，跟随美股期货下行，近期对于美股跟跌不跟涨。长期期间如不出现较大利空，节后资金会回流股市，沪深300指数将小幅反弹，继续区间震荡，如出现较大利空，沪深300指数将破位下行。

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99.655，跌幅0.21%，最高99.995，最低99.615，成交量1.83万手，持仓量5.49万手，日减仓438手;10年期国债期货主力合约T2012报收于97.775，跌幅0.26%，最高98.185，最低97.730，

成交量 5.05 万手，持仓量 10.21 万手,日减仓 1859 手；2 年期国债期货主力合约 TS2012 报收于 100.220，跌幅 0.08%，最高 100.345，最低 100.200，成交量 4340 手，持仓量 2.26 万手，日减仓 107 手。

公开市场有 1000 亿元逆回购到期，开展 500 亿元 14D 逆回购操作，单日净回笼 500 亿元。本周（9 月 28 日至 30 日）公开市场共有 4000 亿元逆回购到期，央行累计进行了 1900 亿逆回购操作，净回笼 2100 亿元。最新公布的 PMI 数据，整体表现不错。财政部通知，10 月 14 日将招标续发 720 亿元 7 年期和 720 亿元 3 年期国债。今日国债期货震荡走弱全线明显收跌。关注假期海外市场的变化。

二、重要经济资讯

1.资金面收敛，Shibor 短端品种全线上行。隔夜品种上行 144.8bp 报 2.361%，7 天期上行 4.8bp 报 2.331%，14 天期上行 11.3bp 报 3.007%，1 个月期上行 1bp 报 2.68%。

2.中国 9 月官方制造业 PMI 为 51.5，预期为 51.3，前值为 51.0；9 月非制造业 PMI 为 55.9，预期为 54.7，前值为 55.2。9 月财新制造业 PMI53，预期 53.1，前值 53.1。

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.