# 宏观金融日报200929

## 内盘股指期货

一、行情回顾

两市股指温和反弹，创业板、科创板表现尤佳，军工股飙升，农业、半导体股造好,银行、保险板块调整。上证指数收报3224.36点,涨0.21%;创业板指报2563.38点，涨1.67%；创业板综指报2941.91点，涨1.49%；深证成指报12900.7点，涨1.10%；科创50报1389.96点，涨3.81%；万得全A报5010.21点，涨0.61%，成交5333亿元,环比上日略增。上证50收于3241.32点,沪深300收于4591.80点,中证500收于6228.77点。

二、行情分析

今日早评中我们说：“昨日两市小幅高开后回落，午后指数在煤炭板块拉动下小幅回升，尾盘指数再度下行，成交量持续萎缩，长假临近，资金观望情绪浓厚。流动性逻辑边际弱化，制约市场估值提升，抱团板块筹码继续松动。投资者期待美国国会在十一月大选之前仍有机会通过新一轮刺激计划，并采取相应纾困措施，为遭受新冠肺炎疫情严重打击的个人和企业提供支持，隔夜美股再度反弹，A股走势较弱，将继续缩量震荡。”实际走势来看股指如期缩量震荡，军工和超跌科技股出现反弹。监管部门已经向大型商业银行发出通知，要求其压降、控制个人住房按揭贷款等房地产贷款规模，利空金融地产板块，权重股走势低迷。美股连续两日反弹，A股连续两日冲高回落，弱势尽显，今日AH溢价指数创新高达到149.39点，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。

## 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99.905,涨幅0.09%,最高100.015,最低98.825，成交量1.59万手，持仓量55341手，日增仓1129手;10年期国债期货主力合约T2012报收于98.045，跌幅0.19%，最高98.275，最低97.985，

成交量5.09万手，持仓量103971手,日减仓438手；2年期国债期货主力合约TS2012报收于100.325，跌幅0.02%，最高100.360，最低100.290，成交量3647手，持仓量21663手，日增仓160手。

央行货币政策委员会于25日召开例会。昨日央行官网公布了会议通稿，与第二季度例会相比，第三季度例会有一些新提法和新要求。删除了“加大宏观政策调节力度”的表述，新增“引导贷款利率继续下行”等表述，关于货币政策指出精准导向。本周期债仅有三个交易日，今日震荡走弱多数收跌。假期在即，保持谨慎，关注明日官方PMI数据的公布。

二、重要经济资讯

1.Shibor短端品种多数上行，隔夜品种自低位反弹31.1bp报0.913%，7天期下行13.5bp报2.283%,14天期上行12.4bp报2.894%,1个月期上行0.4bp报2.67%。

2.央行公开市场开展1000亿元14天期逆回购操作,今日2000亿元逆回购到期,净回笼1000亿元。

**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.