

金融期货

【观点和操作建议】

宏观: 国际方面,美国将于周二迎来总统选举日,在关乎胜负的关键战场州,特朗普与拜登正做最后一搏。民调显示拜登在宾州、佛罗里达和俄亥俄均领先特朗普。民主党有望以 51 对 49 拿下参议院多数席位。国内方面,财新中国制造业 PMI53.6,为 2011 年 2 月以来最高值,前值 53.0,随着国内疫情形势趋稳,经济修复依然是目前宏观经济的主线,经济恢复还将持续数月是大概率事件。

股指: 周一股指期货震荡分化, IH 下跌。盘面上,区间下沿上方震荡整理,两市成交 8124 亿。板块上,白酒、家电、汽车板块领涨。国内经济形势明显向好,三季报上市公司业绩显著复苏,市场调整空间有限,建议轻仓做多破位止损, IF2011 多单 4621.4 止损。

国债: 周一国债期货小涨。现券收益率小幅波动 0-2BP 短升长降,月初流动性压力暂时缓和,主要回购利率多数下行。早盘官方和财新向好的 PMI 数据,一度令债市承压,午后资金面转松,债市转暖。经济基本面良好限制了债市反弹空间,债券市场整体处在偏谨慎的情绪当中,建议暂时离场观望。

一、行情回顾

图表1: 当日行情总结

主力合约	收盘价	涨跌 (%)	成交量	持仓量	日增仓
IF2011	4,711.0	0.59%	75,501	71,661	-3,573
IH2011	3,263.6	-0.26%	30,250	28,896	-926
IC2011	6,109.8	0.45%	79,071	91,917	-4,757
TS2012	100.305	0.03%	6,593	26,859	992

TF2012	99.985	0.12%	19,976	57,726	1,225
T2012	98.300	0.17%	53,303	108,207	1,785

数据来源：文华财经、国元期货

二、现货市场

【现货行情走势】

主要指数	收盘价	成交额(亿元)	日涨跌点	日涨跌幅
上证综指	3,225	3,253	0.6	0.02%
深证成指	13,421	4,871	184.4	1.39%
创业板	2,708	2,312	52.5	1.98%
沪深 300	4,721	2,790	25.5	0.54%
上证 50	3,266	773	-14.5	-0.44%
中证 500	6,143	1,238	31.6	0.52%

数据来源：文华财经、国元期货

【银行间国债到期收益率】

期限	利率(%)	涨跌(bp)
3M	2.66	0.3
1Y	2.75	2.5
2Y	2.87	0.0
3Y	2.95	0.1
5Y	2.98	0.0
7Y	3.18	-0.2
10Y	3.18	-0.2
30Y	3.85	-1.5

数据来源：中国债券网、国元期货

【货币市场利率】

期限	利率(%)	涨跌(bp)
FR001	2.37	7.0
FR007	2.60	-70.0
FR014	2.40	-63.0
Shibor O/N	2.32	8.6
Shibor 1W	2.46	4.6
Shibor 2W	2.41	-61.8

R001	2.41	-51.0
R007	2.80	-57.0

数据来源：中国货币网、国元期货

三、信息资讯

1、四部门联合约谈马云等蚂蚁集团有关人员。央行、银保监会、证监会、外汇局 11 月 2 日对蚂蚁集团实际控制人马云、董事长井贤栋、总裁胡晓明进行了监管约谈。该消息引起市场广泛关注，目前正是蚂蚁集团上市关键时刻。蚂蚁集团对此回应称，会深入落实约谈意见，继续沿着“稳妥创新、拥抱监管、服务实体、开放共赢”的十六字指导方针，持续提升普惠服务能力，助力经济和民生发展。

2、国务院办公厅正式印发《新能源汽车产业发展规划（2021—2035 年）》，要求落实新能源汽车相关税收优惠政策，优化分类交通管理及金融服务等措施。推动充换电、加氢等基础设施科学布局、加快建设，对作为公共设施的充电桩建设给予财政支持，助力新能源汽车产业发展。

3、富时罗素公布通过指数初筛标准的 34 只科创板股票名单，经 2021 年 3 月的半年度审核后，可进入相关指数。届时若这些股票进入沪股通名单，便有望纳入富时罗素全球指数系列，海外被动增量资金可借指数布局。

4、中信建投疑因乌龙指一度闪崩。高频数据显示，中信建投在当日 11 时 28 分 32 秒出现一笔约 9500 手大单成交，将实时股价从 43.04 元/股瞬间打压至

跌停价 38.51 元/股，公司方面回应称一切正常。市场人士分析认为，从中信建投闪崩时成交数据，以及公司消息面、基本面并非发生重大变化情况来看，中信建投闪崩可能是“乌龙指”所致。

5、交易商协会试行非金融企业债务融资工具现金要约收购业务。为提升银行间债券市场服务实体经济质效，交易商协会发布通知，试行非金融企业债务融资工具现金要约收购业务。明确发行人在现金要约收购过程中不得通过内幕交易、操纵市场、利益输送、证券欺诈等影响市场价格的方式获取不当利益。

6、国家领导人对推进农村土地制度改革作出重要指示。国家领导人称，坚持把依法维护农民权益作为出发点和落脚点，扎实推进第二轮土地承包到期后再延长 30 年工作，使农村基本经营制度始终充满活力。。

7、农发行 3 年、5 年期固息增发债中标收益率分别为 3.1733%、3.3388%，投标倍数分别为 8.26、9.2。

重要声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，国元期货力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，也没有考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。

联系我们 全国统一客服电话：400-8888-218

国元期货总部

地址：北京东城区东直门外大街 46 号天恒大厦 B 座 21 层

电话：010-84555000

合肥分公司

地址：合肥市蜀山区金寨路 91 号立基大厦 A 座六楼（中国科技大学金寨路大门斜对面）

电话：0551-62895501

福建分公司

地址：福建省厦门市思明区莲岳路 1 号 2204 室之 01 室（即磐基商务楼 2501 室）

电话：0592-5312522

大连分公司

地址：大连市沙河口区会展路 129 号国际金融中心 A 座期货大厦 2407、2406B。

电话：0411-84807840

西安分公司

地址：陕西省西安市雁塔区二环南路西段 64 号凯德广场西塔 6 层 06 室

电话：029-88604088

上海分公司

地址：中国（上海）自由贸易试验区民生路 1199 弄 1 号楼 3 层 C 区

电话：021-68400292

合肥营业部

地址：合肥市庐阳区国轩凯旋大厦四层（合肥师范学院旁）

电话：0551-68115906、0551-68115888

郑州营业部

地址：郑州市金水区未来路 69 号未来大厦 1410 室

电话：0371-53386892/53386809

青岛营业部

地址：青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 9 层 901 室

电话 0532-66728681

深圳营业部

地址：深圳市福田区园岭街道百花二路 48 号二层（深圳实验小学对面）

电话：0755-82891269

唐山营业部

地址：唐山市路北区北新西道 24 号中环商务 20 层 2003-2005 室

电话：0315-5105115

杭州营业部

地址：浙江省杭州市滨江区江汉路 1785 号网新双城大厦 4 幢 2201-3 室

电话：0571-87686300

通辽营业部

地址：内蒙古通辽市科尔沁区建国路 37 号世基大厦 12 层

电话：0475-6380818