

宏观与金融期货日报

2021/10/26

日报

中粮期货研究院

宏观与金融期货组

范永嘉

电话：010-59137357

投资咨询号

Z0012424

徐乾程

电话：010-59137331

宏观及金融期货要点

- 国家发改委、郑商所四大组合拳进一步促进煤炭保供稳价。
- 证监会高层人士时隔两年半再现变动，深交所原理事长王建军被任命为证监会副主席。
- 国务院办公厅公布 2022 年部分节假日安排。
- 证监会副主席方星海：推动资本市场制度型开放向纵深发展，完善和拓展沪深港通、沪伦通和中日 ETF 互通机制，进一步拓宽期货市场开放范围和路径。
- 生态环境部要求做好全国碳排放权交易市场数据质量监督管理相关工作。
- 发达国家为发展中国家气候行动每年筹集 1000 亿美元资金的集体承诺未能按期在 2020 年兑现。
- 德国 10 月企业信心连续第四个月下滑，供应瓶颈问题持续影响德国工厂产出。

免责声明

本报告信息全部来源于公开性资料，本报告观点可能会与相应公司的投资发展策略或相关商品价格趋势产生分歧，本报告不对所涉及信息的准确性和完整性作任何保证。因此本报告仅可视为经济及金融信息参考但并不构成任何投资建议且不为任何投资行为负责。

热点事件

市场概述

沪深股指强势回弹，上证指数收复 3600 关口，大市成交额连续两日超万亿。截至收盘，上证指数涨 0.76% 报 3609.86 点，深证成指涨 0.72% 报 14596.72 点，创业板指涨 1.64% 报 3338.62 点，万得全 A 涨 0.84% 报 5757.3 点。盘面上，碳中和题材贯穿全场，光电、风电等新能源产业链全面开花，宁德时代、比亚迪创新高。券商、稀土板块午后拉升，长城证券上板，北方稀土涨近 9%。地产、家电、教育板块低迷。创业板新股可孚医疗和科创板新股凯尔达上市首日开盘即破发。北向资金净买入 8.94 亿元，连续 5 日净买入。新能源产业链持续获得持续加仓，阳光电源、天赐材料分别净买入 7.98 亿元、6.48 亿元，赣锋锂业净买入逾 2 亿元，通威股份净买入逾 1 亿元，宁德时代净买入 0.84 亿元。另外，伊利股份获大幅净买入 7.4 亿元，招商银行净买入逾 3 亿元。净卖出方面，格力电器遭大幅净卖出 11.6 亿元，贵州茅台、万科 A 分别遭净卖出 8.43 亿元、6.3 亿元。此外，中国平安净卖出逾 4 亿元，恒瑞医药、比亚迪净卖出逾 2 亿元。

港股全天窄幅震荡，恒生指数收涨 0.02% 报 26132.03 点；恒生科技指数跌 0.14%，恒生国企指数跌 0.37%；大市成交 1112.2 亿港元。燃气、电力、原材料板块领涨，港华燃气涨逾 14%，龙源电力、华润电力等电力龙头走强。地产、餐饮股跌幅居前，佳兆业集团跌超 11%，融创中国跌超 4%；海底捞跌超 9% 领跌蓝筹。南向资金净买入 32.1 亿港元。快手、美团、香港交易所分别获净买入 19 亿港元、4.59 亿港元、4.4 亿港元。净卖出方面，腾讯控股、建设银行、中国电信分别遭净卖出 4.1 亿港元、2.35 亿港元、1.97 亿港元。

美股集体上涨，道指涨 0.18% 报 35741.15 点，标普 500 指数涨 0.47% 报 4566.48 点，刷新历史新高，纳指涨 0.9% 报 15226.71 点。迪士尼、家得宝、visa、沃尔玛均涨超 1%，领涨道指。新能源汽车股大涨，特斯拉涨 12.7%，市值突破 1 万亿美元，股价首次站上 1000 美元。小鹏汽车涨 11.5%。欧洲主要股指多数收涨，德国 DAX 指数涨 0.36% 报 15599.23 点，法国 CAC40 指数跌 0.31% 报 6712.87 点，英国

免责声明

本报告信息全部来源于公开性资料，本报告观点可能会与相应公司的投资发展策略或相关商品价格趋势产生分歧，本报告不对所涉及信息的准确性和完整性作任何保证。因此本报告仅可视为经济及金融信息参考但并不构成任何投资建议且不为任何投资行为负责。

富时 100 指数涨 0.25% 报 7222.82 点，意大利富时 MIB 指数涨 0.92% 报 26815.79 点。

国家发改委、郑商所四大组合拳进一步促进煤炭保供稳价

由于部分能源资讯机构被举报操纵价格指数，国家发改委对煤炭价格指数行为启动行为评估和合规性审查。同时，发改委赴中央企业调研推动煤炭增产增供，要求推动具备增产潜力的煤矿尽快释放产能，已核准且建成的露天煤矿要加快投产达产。发改委还依法加强对煤炭中长期合同履行信用监管，督促签约市场主体严格履行合同约定义务。另外，郑商所也再度上调动力煤期货部分合约交易保证金标准和交易手续费标准。

证监会高层人士时隔两年半再现变动，深交所原理事长王建军被任命为证监会副主席

证监会原副主席阎庆民正式退休，现年 53 岁的深交所原理事长王建军被任命为证监会副主席。此番接任阎庆民履新证监会副主席，系王建军时隔五年重返证监会，同时他也成为证监会最年轻的一位高层领导。

国务院办公厅公布 2022 年部分节假日安排

其中：1 月 31 日至 2 月 6 日为春节放假调休，共 7 天，1 月 29 日、30 日上班；4 月 30 日至 5 月 4 日为劳动节放假调休，共 5 天；10 月 1 日至 7 日为国庆节放假调休，共 7 天，10 月 8 日、9 日上班。

证监会副主席方星海：推动资本市场制度型开放向纵深发展，完善和拓展沪深港通、沪伦通和中日 ETF 互通机制，进一步拓宽期货市场开放范围和路径

持续推动解决制度型开放的关注问题，进一步拓展、优化外资参与中国资本市场的渠道和方式，健全境外主体境内发行上市制度，完善企业境外上市监管制度安排；加快推动解决企业境外上市审计监管相关问题，加强对资本市场跨境投资行为和资本流动的监测和分析研判，对所有重要的跨境交易做到“看得清、管得住”。同时，他表示今年 1 至 9 月，境外投资者通过合格境外投资者、沪深股通等渠道累计净买入 A 股近 2000 亿元，其中，7 至 9 月份净买入 216 亿元。截至 2021 年 9 月末，外资持有 A 股流通市值为 3.53 万亿元，占流通市值比重约 4.8%。

免责声明

本报告信息全部来源于公开性资料，本报告观点可能会与相应公司的投资发展策略或相关商品价格趋势产生分歧，本报告不对所涉及信息的准确性和完整性作任何保证。因此本报告仅可视为经济及金融信息参考但并不构成任何投资建议且不为任何投资行为负责。

生态环境部要求做好全国碳排放权交易市场数据质量监督管理相关工作

配合做好发电行业控排企业温室气体排放报告专项监督执法；将围绕 2019 和 2020 年度碳排放数据质量，对发电行业重点排放单位及相关服务机构开展全面核实，将发现问题交办地方、拉条挂账、一盯到底。

发达国家为发展中国家气候行动每年筹集 1000 亿美元资金的集体承诺未能按期在 2020 年兑现

经合组织秘书长科尔曼发表声明称，根据经合组织的最新评估，发达国家为发展中国家气候行动每年筹集 1000 亿美元资金的集体承诺未能按期在 2020 年兑现，预计这一目标要到 2023 年才能实现。

德国 10 月企业信心连续第四个月下滑，供应瓶颈问题持续影响德国工厂产出

IFO 公布，德国 10 月 IFO 企业景气判断指数跌至 97.7，预估为 97.9，9 月指数上修为 98.9。

预览已结束，完整报告链接和二维码如下：

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_28283

