

宏观与金融期货日报

2019/4/3

日报

中粮期货研究院

宏观与金融期货组

柳瑾

电话：010-59137357

投资咨询号
Z0012424

范永嘉

电话：010-59137341

宏观及金融期货要点

- 道指终结三连涨，纳指涨 0.25%，美债重拾涨势，比特币一度涨超 20%，区块链概念股普涨。
- 媒体：特朗普据称一周三次炮轰鲍威尔，抱怨“把我困住了”。
- 美国 2 月耐用品订单环比下跌 1.6%，同比增速创 16 个月新低。
- 中国央行就“4 月 1 日起降准”谣言致函公安机关，媒体称央行罕见强势“敲打”造谣者背后原因或是“有人短期做多、长期做空”。
- “涨停板敢死队三剑客”之一遭证监会重罚，A 股大批妖股下挫。
- 社保基金会拟减持交行，六个月内不超过 14.9 亿股；媒体称此举理解为调仓换股更合适，交行称减持部分不涉及战略入股。
- 中韩自贸协定谈判稳步推进，我国首次引入负面清单进行服贸和投资谈判。

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

道指终结三连涨，收跌 80 点，纳指盘中下跌后收涨 0.25%，标普基本持平。Walgreens 下调盈利展望，股价暴跌近 13%。美债重拾涨势。比特币上涨约 15%，一度涨超 20%。区块链概念股 Marathon Patent 涨近 19%，迅雷涨近 8%。

沪指上攻 3200 点未果 北上资金一度转为净流出 两市连续两日成交万亿

两市高开，但随后快速走低，在白酒板块的拖累下，指数翻绿，随后大盘稍有回升。大盘拉升之后再度回落，近期回调的燃料电池板块再度回暖，工业大麻也有回升迹象，染料板块依旧是最为突出。午后指数一度冲高，但随后大盘再度回落，深成指、创业板指翻绿，养鸡、养猪、机场等板块全线回落。沪指收盘涨 0.20%；深成指跌 0.07%；创业板跌 0.38%。

证监会盘中处罚“敢死队”、央行罕见喊话、社保减持交行 这传达了什么信号？

4 月 2 日，证监会罕见地于盘中发布行政处罚书，央行罕见借助公安机关破除谣言，社保基金拟减持交行股份，三件大事发生在同一天，或是市场走向发生变化的信号。

央行罕见强势“敲打”造谣者背后原因：“有人短期做多、长期做空”

4 月 2 日，第一财经记者获悉，央行已就“4 月 1 日起降准”的谣言一事正式致函公安机关：请就此次编造发布虚假信息的行为依法进行查处。央行用罕见的强势态度给金融市场的造谣者提醒：造谣重大宏观经济金融政策，将受到严惩。

由于货币市场与资本市场联动性越来越强，第一财经记者从接近央行人士处了解到，“有人短期做多、长期做空”或许是央行态度如此坚决的原因。

接下来，央行会多加强事前提示提醒，防止老百姓被谣言左右，从而影响市场稳定。

罚的是“涨停敢死队”，崩的是高位妖股，监管层在给炒作降温？

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。

一份有些“过时”的处罚书，在周二下午挂上了证监会网站。随后 A 股中活跃的妖股们纷纷中枪……

交通银行：社保基金会拟减持公司股票 六个月内不超过 14.9 亿股

交通银行周二发布公告称，社保基金会已通知公司，计划三个月内，减持本公司 A 股股份不超过 1%；六个月内累计减持本公司 A 股股份不超过总数的 2%。

中韩自贸协定谈判稳步推进 我国首次引入负面清单进行服贸和投资谈判

在中韩自贸协定谈判推进的同时，3 月 25-28 日，中国-挪威自由贸易协定第 14 轮谈判也在京举行，取得积极进展。中国目前已累计与 25 个国家地区达成 17 个自贸协定。

美国 2 月耐用品订单环比下跌 1.6% 同比增速创 16 个月新低

美国 2 月耐用品订单增速 4 个月来第三次下滑，同比增速创 2017 年以来最低水平。

特朗普据称一周三次炮轰鲍威尔 抱怨“把我困住了”

美媒称，过去一周特朗普在三次会议上指责美联储和联储主席鲍威尔，说他让人很难受，怪财长推荐了他，说如果不是联储过去加息，美国经济和股市会表现更好，预算赤字会减少。

【法律声明】

中粮期货有限公司（以下简称“本公司”）具有中国证监会核准的期货投资咨询业务资格（证监会批文号：证监许可[2011]1453）。

报告所引用信息和数据均来源于公开资料和合法渠道，中粮期货分析师力求报告内容和引用资料和数据客观与公正，但不对所引用资料和数据本身的真实性、准确性和完整性做出保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。

免责声明 本报告中的任何观点与建议仅代表报告当日对市场的判断，仅供阅读者参考。阅读者根据本报告做出的任何投资决策及其所产生的一切后果均与本公司无关。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。因此本报告仅供作为经济及金融信息参考，并不构成任何投资建议，也不作为任何投资行为的依据。本公司不承担因本报告内容而产生的任何法律责任。本报告的意见及建议可能与市场评论和/或交易观点不一致。本公司没有将此意见及建议向报告所有接收者进行更新的义务。