

F
U
T
U
R
E
S
R
E
S
E
A
R
C
H
R
E
P
O
R
T

期货研究



每日期货投资观察

2020年12月31日 星期四

宏观经济

	11月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	4.9
官方制造业 PMI (%)	52.1	51.4
工业增加值同比 (%)	7.0	6.9
固定资产投资同比 (%)	2.6	1.8
社会消费品零售同比 (%)	5.0	4.3
出口同比 (%，按美元计)	21.1	11.4
进口同比 (%，按美元计)	4.5	4.7
CPI 同比 (%)	-0.5	0.5
PPI 同比 (%)	-1.5	-2.1
新增贷款 (万亿)	1.43	0.69
新增社会融资规模 (万亿)	2.13	1.42
M1 同比 (%)	10.0	9.1
M2 同比 (%)	10.7	10.5

- 1、**中欧领导人共同宣布如期完成中欧投资协定谈判。**国家领导人指出，中欧投资协定将有力拉动后疫情时期世界经济复苏，增强国际社会对经济全球化和自由贸易的信心，为构建开放型世界经济作出中欧两大市场的重要贡献。商务部表示，中欧投资协定对标国际高水平经贸规则，双方都拿出高水平 and 互惠的市场准入承诺，所有规则都是双向适用。协定涉及领域远远超越传统双边投资协定，谈判成果涵盖市场准入承诺、公平竞争规则、可持续发展和争端解决四方面内容。
- 2、**中国在哪些领域扩大市场开放？**商务部条法司司长李詠箐透露，中方在中欧投资协定中纳入了金融等领域自主开放的举措，同时根据自身发展的需要，有序扩大了部分服务业和部分制造业的开放，比如医院和汽车。中方相信通过进一步扩大开放，可以实现高质量“引进来”，提供更好的产品和服务给人民。
- 3、**人社部调整年金基金投资范围，新增优先股、资产支持证券、同业存单、永续债、国债期货等金融产品和工具，**提高权益类资产投资比例上限，明确年金基金财产投资权益类资产比例，合计不得高于投资组合委托投资资产净值 40%，投资比例上限提高 10 个百分点。按现有年金市场规模测算，本次权益比例上限提高理论上将为资本市场带来 3000 亿的增量资金。

货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	0.6440	2.00
7天 Shibor	2.3080	4.40
14天 Shibor	2.9640	15.90
1个月 Shibor	2.7020	0.00

周三（12月30日）央行公开市场开展400亿元7天期逆回购操作，当日有100亿元逆回购到期，净投放300亿元。资金面宽松，隔夜品种上行2.00bp报0.6440%。

外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
89.6001	6.5305	1.2300
-0.41% -7.08%,Ytd	0.00% -6.25%,Ytd	0.50% 9.61%,Ytd



周三（12月30日）美元指数跌0.41%报89.6001，本周跌0.79%。欧元兑美元涨0.50%报1.2300，英镑兑美元涨0.90%报1.3625，澳元兑美元涨1.03%报0.7686，美元兑日元跌0.32%报103.2050，离岸人民币兑美元涨117个基点报6.5060。在岸人民币兑美元16:30收报6.5307，较前一交易日下跌2个基点，周跌66个基点。人民币兑美元中间价调升126个基点，报6.5325。

海外财经新闻

- 1、欧洲理事会主席米歇尔、欧盟委员会主席冯德莱恩和英国首相约翰逊都相继签署了《英欧贸易和合作协议》。签署后该协议将在 2021 年 1 月 1 日开始临时实施。
- 2、美国约翰斯·霍普金斯大学发布的新冠疫情最新统计数据显示，截至美东时间 12 月 30 日 17 时 22 分，美国新冠肺炎累计确诊病例超 1967 万例，为 19674100 例，死亡病例为 341059 例。较前一日同一时间相比，在过去 24 小时内，美国新增确诊病例 205329 例，新增死亡病例 3849 例。
- 3、美国疾病控制与预防中心新冠疫情负责人亨利·沃克在新闻简报会上表示，在科罗拉多州确诊的首例新冠变种病毒感染病例，因未发现感染者有旅行记录，这表明变种病毒很可能已经在美国人与人之间进行传播。
- 4、德国联邦反垄断局年度反垄断报告显示，该机构今年内针对反垄断案件总共开出约 3.58 亿欧元罚金。该局局长安德烈亚斯·蒙特表示，数字经济是该机构 2020 年工作重点，其目前正对美国数字经济巨头脸书和亚马逊展开调查。
- 5、美国 11 月批发库存环比减 0.1%，预期增 0.6%，前值增 1.1%。
- 6、由于税收激励和疫情驱动的大房子需求继续提振需求，英国 12 月房价上涨速度超过预期，创六年来最大年度涨幅。数据显示，英国 12 月 Nationwide 房价指数环比升 0.8%，预期升 0.4%，前值升 0.9%；同比升 7.3%，预期升 6.7%，前值升 6.5%。

今日关注

1. 09:00 中国 12 月官方制造业 PMI
2. 21:30 美国至 12 月 26 日当周初请失业金人数
3. 23:30 美国至 12 月 25 日当周 EIA 天然气库存

免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，瑞达期货股份有限公司力求准确可靠，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，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。本报告版权仅为我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。



瑞达期货

RUIDA FUTURES