

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10月15日 星期四

### 宏观经济

	9月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	3.2
官方制造业 PMI (%)	51.5	51
工业增加值同比 (%)	-	5.6
固定资产投资同比 (%)	-	-0.3
社会消费品零售同比 (%)	-	0.5
出口同比 (%，按美元计)	9.9	9.5
进口同比 (%，按美元计)	13.2	-2.1
CPI 同比 (%)	-	2.4
PPI 同比 (%)	-	-2
新增贷款 (万亿)	1.90	1.28
新增社会融资规模 (万亿)	3.48	3.58
M1 同比 (%)	8.1	8
M2 同比 (%)	10.9	10.4

- 1、中国9月新增贷款、M2、社会融资规模数据均好于预期。9月新增人民币贷款19000亿元，预期17492亿元，前值12775亿元；M2同比增长10.9%，前值增10.4%；社会融资规模增量为3.48万亿元，比上年同期多9630亿元。
- 2、央行举行第三季度金融统计数据新闻发布会，数据显示资管产品增配非金融企业股票1.86万亿元。对于信贷和社融增速，央行调查统计司司长阮健弘表示，目前仍是合理增长，还没有到偏快增长的状况。
- 3、商务部外贸司司长李兴乾透露，经过深改委审议的《关于推进对外贸易创新发展的实施意见》即将面向全社会公开印发。商务部作为对外贸易主管部门，将会同各地各部门抓好该文件的贯彻落实。
- 4、两部门印发《“工业互联网+安全生产”行动计划（2021-2023年）》提出，要推动技术创新和应用创新，加快互联网、大数据、人工智能、区块链等新一代信息技术在“工业互联网+安全生产”领域的融合创新与推广应用，探索安全生产管理新方式。
- 5、第三届数字中国建设峰会在福州闭幕。本届峰会共签约数字经济项目426个、总投资3316亿元，涵盖人工智能、5G、工业互联网、区块链等前沿领域，将有力推动数字产业化、产业数字化。

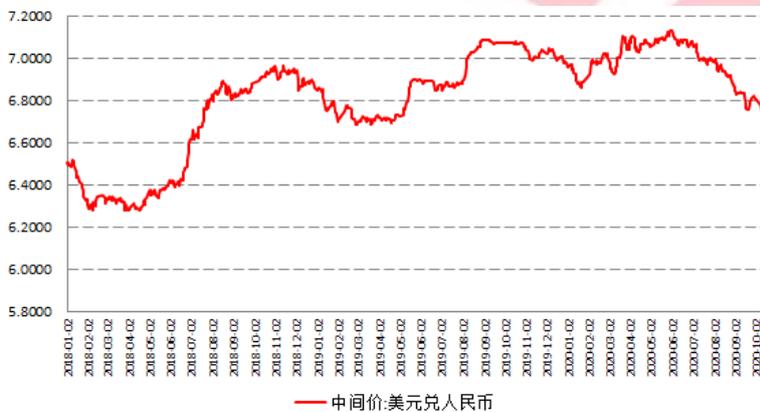
## 货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	1.9620	26.20
7天 Shibor	2.1360	4.40
14天 Shibor	2.06100	8.30
1个月 Shibor	2.6370	0.10

周三（10月14日）央行公告称，目前银行体系流动性总量处于合理充裕水平，当日不开展逆回购操作。500亿元逆回购到期，净回笼500亿元。资金面收敛，Shibor全线上行。

## 外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
93.4209	6.7370	1.1745
-0.12% -3.15%, Ytd	-0.02% -3.29%, Ytd	0.00% 4.74%, Ytd



周三（10月14日）美元指数跌0.12%报93.4209，欧元兑美元持平于1.1745，英镑兑美元涨0.57%报1.3012，澳元兑美元涨0.01%报0.7162，美元兑日元跌0.29%报105.165，离岸人民币兑美元涨259个基点报6.7133。在岸人民币兑美元16:30收报6.7370，较上一交易日上涨15基点。当日人民币兑美元中间价调贬177个基点，报6.7473。

## 海外财经新闻

- 1、美国财长努钦称难以在 11 月初之前敲定刺激计划协议。
- 2、韩国央行将基准利率维持在 0.5%不变，符合市场预期。韩国央行称，长期市场利率波动较大，国内经济复苏依然乏力，经济增长的不确定性很高，将维持宽松的货币政策立场。
- 3、德国央行发布金融稳定评估报告指出，随着新冠疫情进一步发展，德国企业破产和信贷违约情况可能大幅增加。报告预计，2021 年初，德国季度破产企业数量可能增至 6000 多家，其中制造业企业生存形势尤为严峻。
- 4、德国五大权威经济研究所 10 月 14 日发布联合经济预测报告，下调今明两年德国经济预期。报告预测今年德国经济将萎缩 5.4%，比春季预测的萎缩 4.2%更糟；明年德国经济将增长 4.7%，低于上次预测的 5.8%。下调经济预期的主要原因是此次报告预期新冠疫情的影响比春季预期更持久，同时对经济恢复进程的评估更悲观。
- 5、欧盟内部市场委员布雷顿：没必要不惜任何代价达成脱欧协议；尽管如此，更希望达成脱欧协议，但已准备好应对无协议脱欧；未来几天将是脱欧谈判决定性时刻。
- 6、德国经济部：预计德国第三季度经济将出现“有史以来最高的季度增速”；指标显示第四季度经济复苏进程将放缓。

## 今日关注

1. 8:30 澳大利亚 9 月季调后失业率
2. 9:30 中国 9 月 CPI、PPI
3. 14:45 法国 9 月 CPI
4. 20:30 美国 10 月 10 日当周初请失业金人数、9 月进口物价指数、10 月纽约联储制造业指数
5. 22:30 美国 10 月 9 日当周 EIA 天然气库存
6. 23:00 美国 10 月 9 日当周 EIA 原油库存
7. 23:00 美联储负责监管的副主席夸尔斯就新冠肺炎疫情应对进行讨论
8. 英国和欧盟自贸协议谈判最后期限
9. 欧佩克+联合技术委员会（JTC）举行会议

## 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