

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



瑞达期货
RUIDA FUTURES



金尝发

每日期货投资观察 2021年9月27日 星期一

宏观经济

	8月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	7.9
官方制造业 PMI (%)	50.1	50.4
工业增加值同比 (%)	5.3	6.4
固定资产投资同比 (%)	8.9	10.3
社会消费品零售同比 (%)	2.5	8.5
出口同比 (%，按美元计)	25.6	19.3
进口同比 (%，按美元计)	33.1	28.1
CPI 同比 (%)	0.8	1.0
PPI 同比 (%)	9.5	9.0
新增贷款 (万亿)	1.22	1.08
新增社会融资规模 (万亿)	2.96	1.06
M1 同比 (%)	4.2	4.9
M2 同比 (%)	8.2	8.3

- 1、刘鹤出席 2021 年世界互联网大会乌镇峰会时强调，中国宏观经济总体稳定，有经验和能力管控风险，发展前景十分光明，将坚定不移推动改革开放和高质量发展，大力加强新型基础设施建设，推动软件产业发展，持续完善市场化、法治化、国际化营商环境，扩大高水平对外开放，坚持“两个毫不动摇”，支持民营经济健康发展，支持企业家创新创业，支持互联网和数字经济健康发展。
- 2、商务部召开保障节日市场供应，促进消费潜力释放新闻发布会。商务部表示，四季度消费仍将延续平稳恢复态势，预计全年社零总额有望达 44 万亿元，比 2020 年增长 12.5% 左右，比 2019 年增长 8% 左右。下一步，要加快推动汽车由购买管理向使用管理转变，深入开展新能源汽车下乡，促进新车消费。
- 3、全国多地限电限产此起彼伏。广东发布节电倡议书，要求空调制冷温度设置不低于 26℃，办公场所 3 层楼及以下停止使用电梯。东北多地突发限电，路灯停工、不定时停水。A 股市场已有多家上市公司公告，由于供电紧张，为响应当地“能耗双控”要求，上市公司或旗下子公司生产线临时停产。

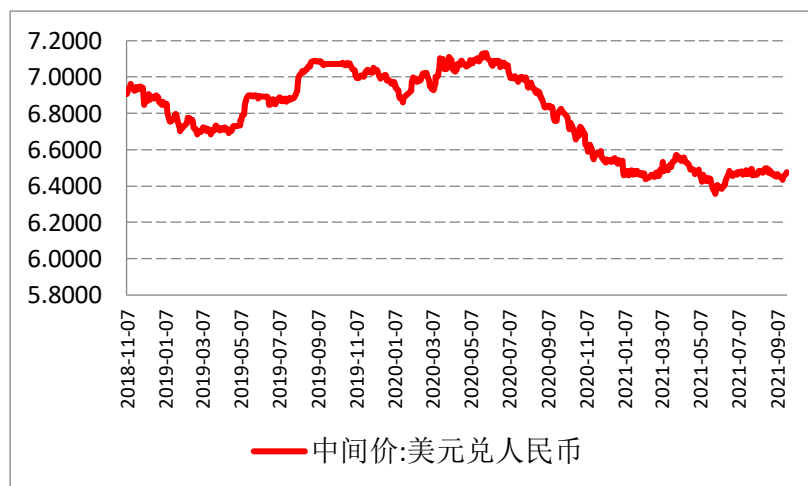
货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	1.6950	-34.00
7天 Shibor	2.2190	3.00
14天 Shibor	2.7090	5.20
1个月 Shibor	2.4080	1.20

周五(9月24日)央行公开市场开展1200亿元14天期逆回购操作,当日500亿元逆回购和700亿元国库现金定存到期。本周累计开展3200亿元逆回购操作,累计有900亿元逆回购和700亿元国库现金定存到期,因此净投放1600亿元。隔夜品种下行34.00bp报1.6950%。

外汇市场

美元指数 93.2851 0.20% 3.71%,Ytd	美元兑人民币 6.4645 0.08% -1.15%,Ytd	欧元兑美元 1.1720 -0.16% -3.78%,Ytd
------------------------------------	--------------------------------------	--------------------------------------



周五(9月24日)美元指数涨0.20%报93.2851,本周涨0.05%。欧元兑美元跌0.16%报1.1720,英镑兑美元跌0.34%报1.3674,澳元兑美元跌0.48%报0.7261,美元兑日元涨0.37%报110.7350,离岸人民币兑美元涨9个基点报6.4615。在岸人民币兑美元16:30收报6.4645,较前一交易日下跌51个基点,周跌124个基点。人民币兑美元中间价调升150个基点,报6.4599。

 海外财经新闻

- 1、美国众议院议长佩洛西表示，众议院可能会在 9 月 27 日通过一揽子基础设施计划，显然拜登计划将少于 3.5 万亿美元。
- 2、今年全球大宗商品价格不断上涨，能源价格走高，欧洲主要地区电力价格同比翻一倍有余，英国电价一年暴涨 7 倍。多个行业生产受到波及，逐渐走高的成本让很多工厂减产甚至停工，更有分析认为电价上涨将间接加大全球性通胀压力。
- 3、美国商务部宣布，该部门已对钕铁硼永磁（Neodymium-iron-boron permanent magnets）进口是否损害美国国家安全启动“232 调查”。这是拜登政府上任以来启动的首个“232 调查”。美国商务部表示，钕铁硼永磁材料应用于战斗机、导弹制导系统等关键国家安全系统，电动汽车、风力涡轮机等关键基础设施，以及电脑硬盘、音频设备、磁共振设备等领域。
- 4、美联储明年票委梅斯特表示，美国经济已经满足了美联储开始缩减 QE 的条件，美联储应该在 11 月开启 Taper，到明年底前可能会满足加息条件。
- 5、美联储官员乔治敦促开始减码，称开始缩减债券购买规模是合适的做法，因为与之相关的经济目标已经实现，未来可能有充分理由维持相对较大的资产负债表规模。
- 6、美国 8 月新屋销售年化 74 万户，连续第二个月回升，预期 71.2 万户，7 月为 70.8 万户；8 月新屋销售环比增 1.5%，预期增 0.6%，7 月环比增 1%。8 月新屋销售同比下滑 24%，降幅为 10 年来最大。

 今日关注

1. 19:45 欧洲央行行长拉加德发表讲话
2. 20:00 美联储埃文斯发表讲话
3. 20:30 美国 8 月耐用品订单月率
4. 21:00 美联储威廉姆斯发表讲话
5. 22:30 美国 9 月达拉斯联储商业活动指数
6. 24:00 美联储威廉姆斯发表讲话

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。