

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

2021年2月2日 星期二

宏观经济

	1月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	6.5
官方制造业 PMI (%)	51.3	51.9
工业增加值同比 (%)	-	7.3
固定资产投资同比 (%)	-	2.9
社会消费品零售同比 (%)	-	4.6
出口同比 (%，按美元计)	-	18.1
进口同比 (%，按美元计)	-	6.5
CPI 同比 (%)	-	0.2
PPI 同比 (%)	-	-0.4
新增贷款 (万亿)	-	1.26
新增社会融资规模 (万亿)	-	1.72
M1 同比 (%)	-	8.6
M2 同比 (%)	-	10.1

- 1、1月财新中国制造业 PMI 下降 1.5 个百分点至 51.5，为 2020 年 7 月以来最低，但仍连续第九个月位于扩张区间。制造业供给、需求继续维持扩张，但速度明显放缓；海外疫情反复导致外贸企业订单减少，对外需造成明显抑制。财新智库高级经济学家王喆表示，1 月制造业总体仍处复苏期，但供给、需求复苏动能减弱，海外需求成为拖累项。
- 2、国家医保局、财政部联合印发通知，决定新增山西等 15 个省份为门诊费用跨省直接结算试点省份，自 2 月 1 日起开展普通门诊费用跨省直接结算试运行工作。
- 3、央行 1 月对金融机构开展中期借贷便利操作共 5000 亿元，期限 1 年，利率为 2.95%；期末中期借贷便利余额为 53500 亿元；对金融机构开展常备借贷便利操作共 376.7 亿元，期末常备借贷便利余额为 331.7 亿元；未对三大政策性银行发放抵押补充贷款，期末抵押补充贷款余额为 32350 亿元。
- 4、国家卫健委：1 月 31 日，31 个省（自治区、直辖市）和新疆生产建设兵团报告新增新冠肺炎确诊病例 42 例，其中境外输入病例 9 例，本土病例 33 例（黑龙江 22 例，吉林 10 例，河北 1 例）；新增无症状感染者 16 例；当日转为确诊病例 5 例。

货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	2.7950	-48.70
7天 Shibor	3.1940	12.30
14天 Shibor	3.2830	-51.50
1个月 Shibor	2.8500	1.80

周一（2月1日）央行公开市场开展 1000 亿元 7 天期逆回购操作，当日有 20 亿元逆回购到期，净投放 980 亿元。隔夜品种下行 48.70bp 报 2.7950%。

外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
91.0272	6.4641	1.2060
0.54% 1.14%, Ytd	0.04% -1.16%, Ytd	-0.64% -1.22%, Ytd



周一（2月1日）美元指数涨 0.54%报 91.0272，本周涨 0.54%。欧元兑美元跌 0.64%报 1.2060，英镑兑美元跌 0.26%报 1.3662，澳元兑美元跌 0.29%报 0.7622，美元兑日元涨 0.21%报 104.9450，离岸人民币兑美元跌 265 个基点报 6.4754。在岸人民币兑美元 16:30 收报 6.4612，较前一交易日下跌 29 个基点，周跌 29 个基点。人民币兑美元中间价调升 86 个基点，报 6.4623。

海外财经新闻

- 1、美国国会预算办公室（CBO）：预计 2020 年实际 GDP 萎缩 2.5%，2021 年美国实际 GDP 将增长 3.7%；预计实际 GDP 将在 2021 年年中恢复到疫情前的水平，并在 2025 年初超过其最大可持续水平；预计 2020 年失业率为 6.8%，2021 年失业率为 5.3%，2022 年为 4.9%。
- 2、日本政府据悉将于 2 月 2 日做出决定，将新冠疫情紧急状态延长至 3 月 7 日，此次延长紧急状态地区包括：东京、神奈川等 10 个都府县。3 月 7 日之前，如果感染状况和医疗紧张状况有所改善，紧急状态也可予以解除。
- 3、韩国免税店协会称，受新冠疫情影响，2020 年韩国免税店销售额同比减少 37.7%，为 15.51 万亿韩元（约合人民币 900 亿元）。疫情下免税店访客数为 1066.9 万人次，仅为 2019 年的 22%。
- 4、欧元区 1 月制造业 PMI 终值为 54.8，预期 54.7，初值 54.7。德国 1 月制造业 PMI 终值为 57.1，预期 57，初值 57；法国制造业 PMI 终值为 51.6，预期 51.5，初值 51.5；英国制造业 PMI 终值为 54.1，预期 52.9，初值 52.9。
- 5、印度计划通过一项法律，在国内禁止比特币等虚拟货币流通使用。与此同时，印度国会发布消息称，将建立相关激励机制推动印度央行推出官方数字货币。虽然印度未来拟禁止其他虚拟货币流通使用，但仍允许企业在印研发、推出与虚拟货币有关技术及应用。

今日关注

1. 待定 欧佩克+两大委员会 JTC 及 JMMC 举行会议
2. 11:30 澳洲联储公布利率决议
3. 15:00 英国 1 月 Nationwide 房价指数月率
4. 15:45 法国 1 月 CPI 月率
5. 18:00 欧元区第四季度 GDP 年率初值
6. 23:00 美国 12 月营建支出月率

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。

