

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4日 星期四

### 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、国务院常务会议听取区域全面经济伙伴关系协定生效实施国内相关工作汇报，要求以深化改革开放促进产业升级。目前对协定涉及的 701 条约束性义务 85%已做好履行准备，要抓紧推进国内相关管理制度改革，制定原产地管理办法和实施指引，完善业务流程，有针对性做好相关技术准备，确保协定生效即可落地实施。
- 2、央行货币政策司司长孙国峰指出，2021 年国内外形势依旧十分复杂，货币政策面临的挑战并不少。货币政策要坚持稳健的总体取向，坚持“稳字当头”，保持战略定力，不左不右。根据经济发展实际情况，灵活调整货币政策力度、节奏和重点，平滑经济波动，应对诸多不确定性。
- 3、受国内外疫情反复等影响，中国 1 月财新服务业 PMI 为 52，环比大幅下降 4.3 个百分点，创近九个月新低。1 月财新综合 PMI 降至 52.2，环比下降 3.6 个百分点，显示整体产出增速仅为小幅增长，为 2020 年 5 月以来最低。
- 4、上海市要求，以浦东高水平改革开放为引领，进一步深化自贸试验区制度创新、改革集成，不断增创国际开放合作和竞争新优势，为上海加快打造国内大循环中心节点和国内国际双循环战略链接发挥更大作用。

## 货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	1.8590	-45.40
7天 Shibor	2.1460	-9.50
14天 Shibor	2.5850	-13.00
1个月 Shibor	2.7720	-3.50

周三（2月3日）央行公开市场开展 1000 亿元 7 天期逆回购操作，当日有 1800 亿元逆回购到期，净回笼 800 亿元。隔夜品种下行 45.40bp 报 1.8590%。

## 外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
91.1129	6.4587	1.2036
0.08% 1.27%, Ytd	-0.02% -1.24%, Ytd	-0.06% -1.45%, Ytd



周三（2月3日）美元指数涨 0.08%报 91.1129，本周涨 0.61%。欧元兑美元跌 0.06%报 1.2036，英镑兑美元跌 0.16%报 1.3646，澳元兑美元涨 0.14%报 0.7620，美元兑日元涨 0.03%报 105.0250，离岸人民币兑美元跌 4 个基点报 6.4581。在岸人民币兑美元 16:30 收报 6.4587，较前一交易日上涨 10 个基点，周涨 25 个基点。人民币兑美元中间价调升 67 个基点，报 6.4669。

## 海外财经新闻

- 1、韩国和柬埔寨自贸协定谈判达成一致。据此，通过《区域全面经济伙伴关系协定》（RCEP）和自贸协定，韩国和柬埔寨将分别取消整体品类中 95.6%和 93.8%的关税。
- 2、澳洲联储主席洛威：经济复苏开始得更早，比预期更强劲；预计在 2024 年之前不会加息，如有必要现金利率将尽可能长地维持在 0.1%；预计到 2021 年底失业率将达 6%；无意实施负利率，将考虑延长面向银行的定期融资工具（TFF）。
- 3、美国 1 月 ADP 就业人数增加 17.4 万人，预期增 4.9 万人，前值由减少 12.3 万人修正至减少 7.8 万人。
- 4、欧元区 2020 年 12 月 PPI 同比降 1.1%，预期降 1.2%，前值降 1.9%；环比升 0.8%，预期升 0.7%，前值升 0.4%。
- 5、德国 1 月综合 PMI 终值为 50.8，预期 50.8，初值 50.8；服务业 PMI 终值为 46.7，预期 46.8，初值 46.8。

瑞达期货  
RUIDA FUTURES

## 今日关注

1. 16:00 瑞士第一季度消费者信心指数
2. 18:00 欧元区 12 月零售销售月率
3. 20:00 英国央行公布利率决议及政策声明
4. 20:30 英国央行行长贝利召开新闻发布会
5. 20:30 美国 1 月挑战者企业裁员人数
6. 21:30 美国至 1 月 30 日当周初请失业金人数
7. 23:00 美国 12 月工厂订单月率
8. 23:30 美国至 1 月 29 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。

