

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12日 星期一

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)	-	9.5
进口同比 (%，按美元计)	-	-2.1
CPI 同比 (%)	-	2.4
PPI 同比 (%)	-	-2
新增贷款 (万亿)	-	1.28
新增社会融资规模 (万亿)	-	3.58
M1 同比 (%)	-	8
M2 同比 (%)	-	10.4

- 1、国务院常务会议部署进一步做好稳就业工作，确保完成全年目标任务；通过《新能源汽车产业发展规划》，培育壮大绿色发展新增长点；决定在粤港澳大湾区部分地方推广实行国际航运相关税收优惠政策，推动更高水平对外开放。
- 2、国务院：从今年10月1日至2023年12月31日，对在南沙自贸片区开展国际航运保险业务给予一定的税收优惠；从今年10月1日起，对以珠三角9市37个港口为启运港、以南沙保税港区和前海保税港区为离境港的水运货物实行启运港退税政策，境内货物启运出口即可退税，减少企业资金占压成本。
- 3、中共中央办公厅、国务院办公厅印发《深圳建设中国特色社会主义先行示范区综合改革试点实施方案（2020—2025年）》，要求在中国人民银行数字货币研究所深圳下属机构的基础上成立金融科技创新平台。支持开展数字人民币内部封闭试点测试，推动数字人民币的研发应用和国际合作。
- 4、央行：9月，对金融机构开展SLF操作共24.5亿元，期末SLF余额为24.5亿元；对金融机构开展MLF操作共6000亿元，期末MLF余额为41000亿元；国开行、进出口行、农发行净归还PSL达197亿元，期末PSL余额为34343亿元。
- 5、中国9月财新服务业PMI为54.8，连续五个月处于扩张区间，预期54.3，前值54。

货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	1.6280	-41.00
7天 Shibor	2.0290	-14.50
14天 Shibor	2.0540	-42.40
1个月 Shibor	2.6490	-1.90

周六（10月10日）央行公告称，目前银行体系流动性总量处于较高水平，当日不开展逆回购操作。Shibor 短端品种全线下行，隔夜品种下行 41bp 报 1.6280%。

外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
93.0109	6.7135	1.1825
-0.63% -3.46%, Ytd	-1.43% -6.63%, Ytd	0.59% 5.35%, Ytd



周五（10月9日）美元指数跌 0.63% 报 93.0109，本周跌 0.85%，连跌两周。非美货币集体上涨，欧元兑美元涨 0.59% 报 1.1825，英镑兑美元涨 0.91% 报 1.3054，澳元兑美元涨 1.03% 报 0.7242，美元兑日元跌 0.4% 报 105.605，离岸人民币兑美元涨 481 个基点报 6.6907。

在岸人民币兑美元 16:30 收盘报 6.7135，较上一交易日上涨 971 个基点，创 17 个月来高位。人民币兑美元中间价调升 305 个基点，报 6.7796。

海外财经新闻

- 1、据美国约翰斯·霍普金斯大学数据，全球新冠肺炎累计确诊病例超 3736 万例，累计死亡逾 107 万例。其中，美国累计确诊超 775 万例。
- 2、美国财长努钦将向美国众议院议长佩洛西提交规模为 1.8 万亿美元的援助法案提案。美国国家经济顾问库德洛：特朗普希望就刺激方案达成协议，已经批准了修订后的经济刺激方案。
- 3、英国和欧盟已同意即使下周可能面临更广泛的贸易协议谈判破裂的情况，其仍将在航空和公路运输等具有共同利益的领域达成“微型协议”。
- 4、英国财政大臣苏纳克：将宣布对封锁地区的就业支持计划；数据显示，英国经济已经连续 4 个月增长，但很多人都在担心即将到来的冬季。
- 5、意大利工业联合会预计，意大利经济将在 2020 年萎缩 10%，2021 年可能会增长 4.8%。
- 6、日本中央银行日本银行宣布，将于 2021 年启动数字货币实证实验。日本银行表示，目前没有发行数字货币的计划，但正在推动建立可应对数字化进展的机制。
- 7、印度央行维持基准利率在 4% 不变，并预计 2021 财年实际 GDP 将萎缩 9.5%。印度央行行长表示，如果有需要，将宣布 1 万亿卢比定向长期再融资操作。
- 8、美国 8 月批发销售环比增 1.4%，预期增 2%，前值由增 4.6% 修正为 4.8%。
- 9、英国至 8 月三个月 GDP 环比升 8%，预期升 8.2%，前值降 7.6%；8 月 GDP 同比降 9.3%，预期降 7.5%，前值降 11.7%；环比升 2.1%，预期升 4.6%，前值升 6.6%。
- 10、法国 8 月工业产出同比降 6.2%，预期降 5.7%，前值降 8.3%；环比升 1.3%，连续第四个月升幅放缓，预期升 1.7%，前值升 3.8%。
- 11、意大利 8 月调整后工业产出同比降 0.3%，预期降 6.6%，前值降 8%；季调后环比升 7.7%，预期升 1.3%，前值自升 7.4% 修正至升 7%。

今日关注

1. 07:50 日本 8 月核心机械订单、9 月国内企业商品物价指数
2. 14:00 德国 9 月批发物价指数

3. 19:00 欧洲央行行长拉加德在 IMF 举行的会议上发表讲话
4. 2020 年世界激光制造大会将在深圳开幕
5. 加拿大、巴西、阿根廷休市一日



瑞达期货

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。