

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7月2日 星期五

宏观经济

	6月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	18.3
官方制造业 PMI (%)	50.9	51.0
工业增加值同比 (%)	-	8.8
固定资产投资同比 (%)	-	15.4
社会消费品零售同比 (%)	-	12.4
出口同比 (%，按美元计)	-	27.9
进口同比 (%，按美元计)	-	51.1
CPI 同比 (%)	-	1.3
PPI 同比 (%)	-	9.0
新增贷款 (万亿)	-	1.50
新增社会融资规模 (万亿)	-	1.92
M1 同比 (%)	-	8.3
M2 同比 (%)	-	6.1

- 6月财新中国制造业 PMI 微降至 51.3，低于 5 月 0.7 个百分点，为三个月以来的低点，显示受疫情反复和供应链受阻影响，6 月中国制造业增长势头减弱。
- 证监会披露，贝莱德基金申报首只国内公募基金产品——贝莱德中国新视野混合型证券投资基金。今年 6 月 11 日，证监会向贝莱德基金颁发业务许可证，批准其以公募基金管理公司的形式开展业务活动。
- 9 家券商集中披露上半年业绩预告，累计披露数量增至 13 家。3 家券商净利润预增规模最高超 20 亿元，海通证券以最高 27.42 亿元排名第一，中信证券 26.78 亿元紧随其后，国信证券 21.54 亿元排名第三；中金公司、招商证券增加规模均超 10 亿元。财达证券以最高增 125% 排名增幅第一，东方证券、西南证券增幅有望达到 80%。
- 全球经济复苏带来的需求改善及油价上涨刺激“两桶油”上半年大幅扭亏。中国石油、中国石化同步发布业绩预告，中石油预计上半年净利润同比将增加 750 亿元到 900 亿元，中石化则预计上半年净利润 365 亿元到 385 亿元，上年同期两公司净亏损分别高达 299.86 亿元、299 亿元。

货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	1.7340	-44.30
7 天 Shibor	2.1860	-21.90
14 天 Shibor	2.1990	-76.70
1 个月 Shibor	2.4070	-0.80

周四（7月1日）央行公开市场开展 100 亿元 7 天期逆回购操作，当日 300 亿元逆回购到期，净回笼 200 亿元。隔夜品种下行 44.30bp 报 1.7340%。

外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
92.5345	6.4640	1.1849
0.18% 2.83%, Ytd	0.04% -1.15%, Ytd	-0.06% -2.99%, Ytd



周四(7月1日)美元指数涨 0.18%报 92.5345, 本周涨 0.81%。欧元兑美元跌 0.06%报 1.1849, 英镑兑美元跌 0.50%报 1.3763, 澳元兑美元跌 0.39%报 0.7470, 美元兑日元涨 0.38%报 111.5250, 离岸人民币兑美元跌 50 个基点报 6.4729。在岸人民币兑美元 16:30 收报 6.4640, 较前一交易下跌 28 个基点, 周跌 87 个基点。人民币兑美元中间价调贬 108 个基点, 报 6.4709。



海外财经新闻

- 1、美国 6 月 ISM 制造业 PMI 降至 60.6，略低于市场预期，但仍连续 13 个月处于扩张区间。ISM 表示，工人缺乏、零件短缺导致的短期停工、空缺职位难以填补等问题继续限制着制造业的增长潜力。
- 2、美国 6 月 Markit 制造业 PMI 终值 62.1，略低于预期及初值。IHS Markit 首席经济学家表示，需求激增推动美国制造业产出再次大幅上升，新订单和生产增速均创纪录最高水平。但产能限制以及材料和劳动力的短缺继续阻碍增长势头，这意味着对价格的担忧继续加剧。
- 3、欧元区 6 月制造业 PMI 终值录得 63.4，续创历史新高，预期 63.1，初值 63.1。德国 6 月制造业 PMI 终值录得 65.1，预期 64.9，初值 64.9。法国 6 月制造业 PMI 终值录得 59，预期 58.6，初值 58.6。
- 4、欧元区 5 月失业率为 7.9%，创去年 6 月以来新低，预期 8%，前值从 8%修正为 8.1%。
- 5、就业网站 Monster 报告显示，美国“大辞职”潮来临，高达 95%的员工正考虑换工作。据美国劳工部数据，光是 4 月就有 400 万人辞职，创下历史新高，最新职位空缺数则达创纪录的 930 万个。尽管职位空缺数量不断刷新纪录，但招聘网站 Indeed 调查显示，只有约 10%的求职者迫切地在积极寻找新工作，首要原因是害怕感染新冠。
- 6、英国央行行长贝利：看到通胀压力持续上升的迹象，准备用货币政策工具来应对，预计通胀上升是暂时的，不对暂时性通胀反应过度；英国经济可能会回到较低增长的状态，重要的是要确保经济复苏不会受到过早收紧货币政策的影响。



今日关注

1. 17:00 欧元区 5 月 PPI 月率
2. 20:30 美国 5 月贸易帐
3. 20:30 美国 6 月失业率
4. 20:30 美国 6 月季调后非农就业人口
5. 20:30 欧洲央行行长拉加德发表讲话
6. 22:00 美国 5 月工厂订单月率

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。