

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10月14日 星期四

宏观经济

	9月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	7.9
官方制造业 PMI (%)	49.6	50.1
工业增加值同比 (%)	-	5.3
固定资产投资同比 (%)	-	8.9
社会消费品零售同比 (%)	-	2.5
出口同比 (%，按美元计)	28.1	25.6
进口同比 (%，按美元计)	17.6	33.1
CPI 同比 (%)	-	0.8
PPI 同比 (%)	-	9.5
新增贷款 (万亿)	1.66	1.22
新增社会融资规模 (万亿)	2.90	2.96
M1 同比 (%)	3.7	4.2
M2 同比 (%)	8.3	8.2

- 1、今年前三季度，我国外贸进出口总值 28.33 万亿元，同比增长 22.7%。其中出口 15.55 万亿元，同比增长 22.7%；进口 12.78 万亿元，同比增长 22.6%。外贸进出口已连续 5 个季度实现同比正增长。海关总署表示，考虑到 2020 年外贸高基数的影响，今年四季度进出口增速可能有所回落，但我国外贸总体向好的趋势不会改变，全年仍然有望实现较快增长。
- 2、中国 9 月金融数据出炉，M2 同比增 8.3%，预期增 8.1%，前值增 8.2%；新增人民币贷款 1.66 万亿元，预期 1.9 万亿元，前值增 1.22 万亿元；社会融资规模增量为 2.9 万亿元，预期 3.24 万亿元，前值 2.96 万亿元。中信证券表示，9 月信贷低于预期，维持四季度社融增速有望反弹的观点，支撑因素包括政府债券剩余额度较多、房贷投放节奏有望边际调整以及再贷款的逐步投放等。
- 3、国家发改委主任何立峰主持召开煤电油气运保障工作部际协调机制全体成员会议，强调要依法依规加快释放煤炭先进产能，加快非计划停运煤电机组并网运行，科学有序实施“压非保民”，坚决守住民生用能底线；坚决纠正一些地方不适当行政措施，坚决防止一家企业出事故、全域企业停产整顿等情况发生。

货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	2.1570	5.60
7天 Shibor	2.2020	3.50
14天 Shibor	2.1990	1.60
1个月 Shibor	2.3570	-0.60

周三(10月13日)央行公开市场开展100亿元7天期逆回购操作,当日1000亿元逆回购到期,净回笼900亿元。隔夜品种上行5.60bp报2.1570%。

外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
94.0244	6.4452	1.1597
-0.52% 4.59%, Ytd	-0.18% -1.51%, Ytd	0.58% -4.98%, Ytd



周三(10月13日)美元指数跌0.52%报94.0244,本周跌0.08%。欧元兑美元涨0.58%报1.1597,英镑兑美元涨0.54%报1.3661,澳元兑美元涨0.38%报0.7378,美元兑日元跌0.31%报113.2500,离岸人民币兑美元涨273个基点报6.4284。在岸人民币兑美元16:30收报6.4452,较前一交易日上涨113个基点,周涨39个基点。人民币兑美元中间价调贬165个基点,报6.4612。



海外财经新闻

- 1、美联储公布的会议纪要显示，与会官员表示，如果 11 月的议息会议上决定开始缩减购债，那么可能从 11 月中旬或 12 月中旬的月度购买日期开始实施减码操作，整个缩减购债计划可能在 2022 年年中结束。美联储官员们讨论了减码的具体路径：减少每月的资产购买规模，其中对美债的购买减少 100 亿美元，对抵押贷款支持证券的购买规模减少 50 亿美元。另外，通胀正在以多年来最快的速度上升，远高于美联储 2% 的目标。一些官员表示，供应瓶颈和生产问题使通胀压力持续时间可能比预期更长。
- 2、美国国会众议院通过一项短期调高联邦政府债务上限的法案，暂时避免政府债务违约风险。该法案将暂时调高债务上限约 4800 亿美元，确保美国财政部可履行支付义务至 12 月 3 日。由于参议院上周已通过这项法案，该法案随后将递交总统拜登签署生效。
- 3、美国 9 月 CPI 同比升幅扩大至 5.4%，创 1991 年 1 月以来的最高水平，此前市场预期将持平于 8 月份的 5.3%。分析机构认为，美国 9 月 CPI 升幅超出预期，突显出经济中通胀压力的持续存在。
- 4、日本 8 月核心机械订单环比降 2.4%，预期增 1.4%，前值增 0.9%。日本内阁府将其对机械订货情况的总体判断从“出现回升动向”下调为“恢复势头出现原地踏步迹象”。



今日关注

1. 08:30 澳大利亚 9 月季调后失业率
2. 09:30 中国 9 月 CPI 年率
3. 16:00 IEA 公布月度原油市场报告
4. 20:30 美国 9 月 PPI 月率
5. 20:30 美国至 10 月 9 日当周初请失业金人数
6. 22:00 美联储博斯蒂克发表讲话
7. 22:30 美国至 10 月 8 日当周 EIA 天然气库存
8. 23:00 美国至 10 月 8 日当周 EIA 原油库存

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。