

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18日 星期一



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 (%)	0.7	0.8
PPI 同比 (%)	10.7	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、央行召开三季度金融统计数据新闻发布会，回应是否降准、房地产信贷、恒大债务风险等热点问题。央行指出，四季度流动性供求形势基本平衡，将继续坚持稳健货币政策；部分金融机构对试点房企“三线四档”融资管理规则存在误读，将指导主要银行准确把握和执行好房地产金融审慎管理制度，保持房地产信贷平稳有序投放，维护房地产市场平稳健康发展。
- 2、教育部官网公布《教育部办公厅关于设立教育部基础教育综合改革实验区的通知》。经研究，决定在上海市、广东省深圳市、四川省成都市、河北省廊坊市、山西省长治市、江苏省常州市、浙江省金华市、安徽省铜陵市、福建省三明市、湖北省宜昌市、陕西省西安市高新区、山东省诸城市设立教育部基础教育综合改革实验区。据悉，教育部设立全国基础教育综合改革实验区，通过深化综合改革，探路先行，切实解决基础教育健康发展面临的突出问题，全面提高基础教育质量。
- 3、据上海证券报，中小企业即将迎来新一轮政策支持。国家发展改革委、工业和信息化部、央行等多部门日前密集发声，将对中小企业加大针对性支持力度，政策聚焦减税降费、增加信贷、支持企业创新、构建优良营商环境等方面。

货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	2.0650	-4.10
7天 Shibor	2.1320	-6.60
14天 Shibor	2.1450	-15.50
1个月 Shibor	2.3582	-0.08

周五(10月15日)央行公开市场开展5000亿元MLF和100亿元7天期逆回购操作,当日有5000亿元MLF和100亿元逆回购到期。本周累计500亿元逆回购和5000亿元MLF操作,有5100亿元逆回购和5000亿元MLF到期,因此净回笼4600亿元。隔夜品种下行4.10bp报2.0650%。

外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
93.9657	6.4291	1.1599
-0.02% 4.53%,Ytd	-0.07% -1.76%,Ytd	0.02% -4.95%,Ytd



周五(10月15日)美元指数跌0.02%报93.9657,本周跌0.14%。欧元兑美元涨0.02%报1.1599,英镑兑美元涨0.50%报1.3744,澳元兑美元涨0.08%报0.7422,美元兑日元涨0.51%报114.2550,离岸人民币兑美元涨13个基点报6.4345。在岸人民币兑美元16:30收报6.4291,较前一交易日上涨48个基点,周涨200个基点。人民币兑美元中间价调升28个基点,报6.4386。



海外财经新闻

- 1、美国交通部长皮特·布蒂吉格表示，美国面临的供应链问题将持续到 2022 年，美国总统拜登的基础设施法案或是缓解此问题的最佳方式。
- 2、欧洲央行行长拉加德表示，货币政策将继续支持经济，致力于维持有利的融资环境；相信通胀在很大程度上是暂时的，正关注薪资谈判对通胀第二轮影响。
- 3、美联储哈克预计，2022 年底或 2023 年初前不会加息，除非通胀形势发生显著变化；预计美国 2021 年 GDP 增速将达 5.5% 左右，2022 年将达 3.5% 左右。美联储将很快开始缩减每月资产购买规模，预计 2021 年通货膨胀率将达 4%。
- 4、欧洲央行管委、比利时央行行长埃尔·文施表示，通胀飙升是暂时的，通胀第二轮效应存在不确定性，经济正朝着正确方向发展，需要耐心等待，还没有达到通胀目标，在实施刺激措施上相当灵活。
- 5、据央视财经，中美海运价格大幅回落，每个集装箱降约 3000 美元。全球波罗的海货柜运价指数 (FBX) 显示，亚洲至美西运价指数已从 9 月中上旬超过每 40 英尺集装箱 20000 美元的价格，下降至每 40 英尺集装箱 17377 美元。
- 6、美国 9 月零售销售环比升 0.7%，预期降 0.2%，前值升 0.7%；零售销售同比升 13.95%，预期升 15.1%；核心零售销售环比升 0.8%，预期升 0.5%，前值升 1.8%。



今日关注

1. 10:00 中国第三季度 GDP 年率
2. 21:15 美国 9 月工业产出月率
3. 22:00 美国 10 月 NAHB 房产市场指数

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。