

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22日 星期五

宏观经济

| | 9月实际值 | 前值 |
|---------------|-------|------|
| GDP 同比 (%) | 4.9 | 7.9 |
| 官方制造业 PMI (%) | 49.6 | 50.1 |
| 工业增加值同比 (%) | 3.1 | 5.3 |
| 固定资产投资同比 (%) | 7.3 | 8.9 |
| 社会消费品零售同比 (%) | 4.4 | 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、中办、国办印发《关于推动城乡建设绿色发展的意见》，要求加强财政、金融等政策支持，推动高质量绿色建筑规模化发展，大力推广超低能耗、近零能耗建筑，发展零碳建筑。完善以市场为导向的城乡建设绿色技术创新体系，培育壮大一批绿色低碳技术创新企业。
- 2、央行行长易纲表示，系统重要性金融机构附加监管不会产生太大资本补充压力，有助于避免信贷紧缩效应。统筹实施货币政策和宏观审慎政策。现阶段利息收入在我国银行业收入中仍占有较大比重，保持正常货币政策，保持利差水平处于合理区间，有利于促进银行体系更好地为实体经济增长服务，也有利于维护金融稳定。未来将继续坚持金融分业经营的基本格局，强化风险隔离体制机制建设，维护金融系统稳定运行。
- 3、央行副行长范一飞指出，保持稳健的货币政策灵活精准合理适度，保持货币供应量和社会融资规模增速与 GDP 增速基本匹配。坚持把服务实体经济放到更加突出的位置，维护经济大局总体平衡，增强经济发展韧性。
- 4、国家发改委力挺民营经济发展，将研究建立混改引战对接机制；围绕国家重大战略，在新能源、储能设施建设等领域开展增量混改。

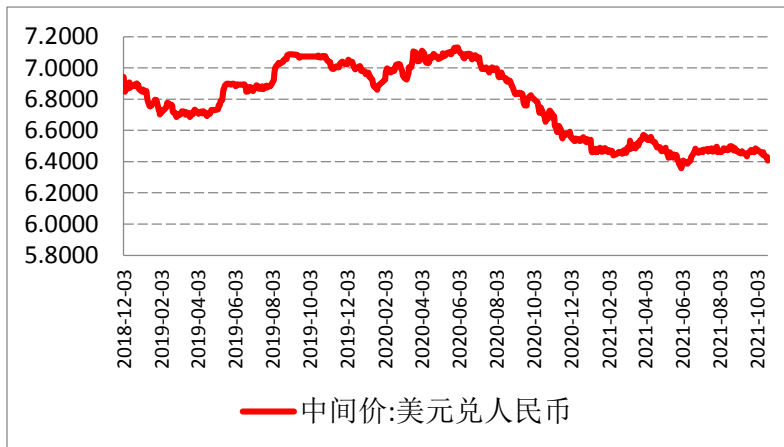
货币市场

| | 利率水平 | 较前一日变动 (bp) |
|-------------|--------|----------------|
| 隔夜 Shibor | 1.6830 | -42.10 |
| 7 天 Shibor | 2.0550 | -16.60 |
| 14 天 Shibor | 2.4560 | 6.10 |
| 1 个月 Shibor | 2.3660 | 0.30 |

周四（10月21日）央行公开市场开展 1000 亿元 7 天期逆回购操作，当日有 100 亿元逆回购到期，净投放 900 亿元。隔夜品种下行 42.10bp 报 1.6830%。

外汇市场

| 美元指数 | 美元兑人民币 | 欧元兑美元 |
|------------------|-------------------|--------------------|
| 93.7562 | 6.3988 | 1.1625 |
| 0.15% 4.30%, Ytd | 0.08% -2.24%, Ytd | -0.22% -4.74%, Ytd |



周四(10月21日)美元指数涨0.15%报93.7562,本周跌0.23%。欧元兑美元跌0.22%报1.1625,英镑兑美元跌0.23%报1.3794,澳元兑美元跌0.68%报0.7466,美元兑日元跌0.30%报114.0100,离岸人民币兑美元涨4个基点报6.3945。在岸人民币兑美元16:30收报6.3988,较前一交易日下跌52个基点,周涨303个基点。人民币兑美元中间价调升179个基点,报6.3890。

 海外财经新闻

- 1、**美联储宣布限制高级官员交易的新规则。**根据新规定，美联储政策制定者和高级官员必须在购买和出售证券时提前 45 天发出通知。新的交易限制规定禁止美联储政策制定者和高级官员购买股票、持有个别债券或机构证券，或进入衍生品市场；地区联储主席必须在进行交易后的 30 天内披露交易信息。
- 2、**二十国集团 (G20) 主席国意大利 10 月 13 日在华盛顿主持召开 G20 财长和央行行长会议，讨论全球经济形势、全球公共产品与支持脆弱经济体、国际税收、金融监管等议题，并发表公报。**中国财政部部长刘昆以视频方式出席会议并发言。
- 3、**美联储理事沃勒表示，缩减购债规模符合美国经济前景；**当开始缩减购债规模时，市场应该不会出现大的波动。如果通货膨胀持续过高，美联储可能不得不采取更快行动。沃勒认为，通胀率将在 2022 年下降，接近美联储设定的 2% 的目标。
- 4、**美联储博斯蒂克称，混乱和高通胀将持续到 2022 年；**目前还没有看到经济破坏的迹象，将继续密切关注；没有看到通胀陷入困境的势头；削减资产购买是第一步，将观察经济和市场的反应。
- 5、**美国 10 月费城联储制造业指数为 23.8，预期 25，前值 30.7；**就业指数为 30.7，前值 26.3；物价获得指数为 51.1，前值 52.9；新订单指数为 30.8，前值 15.9；物价支付指数为 70.3，前值 67.3；装船指数为 30，前值 29.9。

 今日关注

1. 09:00 美联储威廉姆斯发表讲话
2. ④ 14:00 英国 9 月季调后零售销售月率
3. ⑤ 15:15 法国 10 月制造业 PMI 初值
4. ⑥ 15:30 德国 10 月制造业 PMI 初值
5. ⑦ 16:00 欧元区 10 月制造业 PMI 初值
6. ⑧ 16:30 英国 10 月制造业及服务业 PMI
7. ⑨ 20:30 加拿大 8 月零售销售月率
8. ⑩ 21:45 美国 10 月 Markit 制造业 PMI 初值
9. ⑪ 21:45 美国 10 月 Markit 服务业 PMI 初值
10. ⑫ 23:00 美联储主席鲍威尔出席小组讨论会

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。