

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

2021年2月1日 星期一

宏观经济

	1月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	6.5
官方制造业 PMI (%)	51.3	51.9
工业增加值同比 (%)	-	7.3
固定资产投资同比 (%)	-	2.9
社会消费品零售同比 (%)	-	4.6
出口同比 (%，按美元计)	-	18.1
进口同比 (%，按美元计)	-	6.5
CPI 同比 (%)	-	0.2
PPI 同比 (%)	-	-0.4
新增贷款 (万亿)	-	1.26
新增社会融资规模 (万亿)	-	1.72
M1 同比 (%)	-	8.6
M2 同比 (%)	-	10.1

- 1、中国1月官方制造业PMI为51.3，预期51.3，前值51.9；非制造业PMI为52.4，前值55.7。
- 2、国家领导人主持中央政治局第二十七次集体学习时强调，完整、准确、全面贯彻新发展理念，既要以新发展理念指导引领全面深化改革，又要通过深化改革为完整、准确、全面贯彻新发展理念提供体制机制保障；要自觉主动解决地区差距、城乡差距、收入差距等问题，坚持在发展中保障和改善民生，统筹做好就业、收入分配、教育、社保、医疗、住房、养老、扶幼等各方面工作。
- 3、中办、国办印发《建设高标准市场体系行动方案》明确，研究制定重大市场风险冲击应对预案，提高各类养老金、保险资金等长期资金的权益投资比例，支持社会资本依法进入银行、证券、资产管理、债券市场等金融服务业。
- 4、对于社会关注度比较高的个人住房贷款有关问题，四大国有银行和部分股份制银行广州分行普遍反映，当前房贷业务有序开展，未来进一步落实“房住不炒”定位，加强审贷管理，继续做好金融服务。

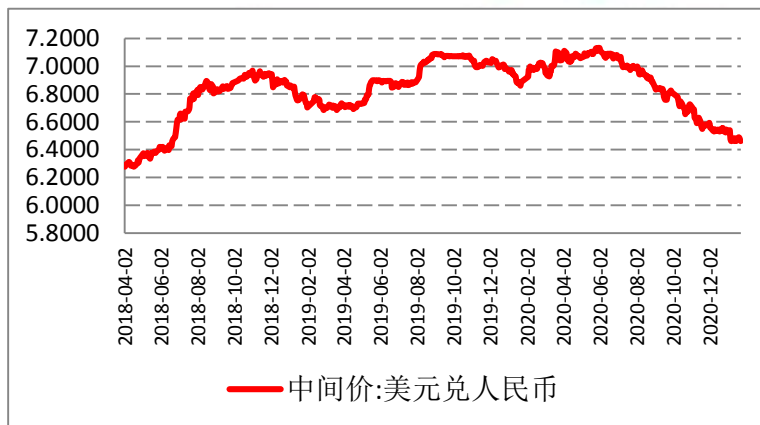
货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	3.2820	25.80
7 天 Shibor	3.0710	9.00
14 天 Shibor	3.7980	24.30
1 个月 Shibor	2.8320	12.40

周五（1月29日）央行公开市场开展 1000 亿元 7 天期逆回购操作，当日有 20 亿元逆回购到期。本周央行公开市场有 6140 亿元逆回购和 2405 亿元 TMLF 到期，累计进行了 3840 亿元逆回购操作，净回笼 4705 亿元。隔夜品种上行 25.80bp 报 3.2820%。

外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
90.5382	6.4612	1.2138
-0.01% 0.64%, Ytd	-0.23% -1.20%, Ytd	0.12% -0.76%, Ytd



周五（1月29日）美元指数跌 0.01%报 90.5382，本周涨 0.36%。欧元兑美元涨 0.12%报 1.2138，英镑兑美元跌 0.20%报 1.3698，澳元兑美元跌 0.43%报 0.7644，美元兑日元涨 0.44%报 104.7200，离岸人民币兑美元涨 263 个基点报 6.4489。在岸人民币兑美元 16:30 收报 6.4612，较前一交易日上涨 146 个基点，周涨 165 个基点。人民币兑美元中间价调升 136 个基点，报 6.4709。

海外财经新闻

- 1、IMF 报告指，截至去年底，全球抗疫的财政支持接近 14 万亿美元，公共债务占全球本地生产总值的比例从 2019 年 10 月的 84% 攀升至去年底的 98%。
- 2、美联储卡普兰：如果有进一步财政支持，美国今年经济增速可能超过 5%；不会将时间框架与美联储目标的“进一步实质性进展”相联系；预计今年美国的原油和天然气生产将趋于平缓，可能要到 2022 年第一季度才能实现供需平衡。
- 3、新冠疫苗的持续变异引起了全球科学家的担忧。美国冠状病毒大流行首席医学顾问安东尼·福奇（Anthony Fauci）博士首次承认，新冠疫苗对抗病毒变异的效力降低。美国 FDA 正考虑获得疫苗针对变异病毒免疫保护的新数据。
- 4、美国约翰斯·霍普金斯大学统计数据显示，截至美东时间 1 月 29 日 16 时 22 分，美国累计新冠肺炎确诊病例达 25874892 例，累计死亡人数达 435452 人。
- 5、美国去年 12 月核心 PCE 物价指数环比增 0.3%，预期增 0.1%，前值持平；同比增 1.5%，创去年 9 月以来新高，预期增 1.3%，前值增 1.4%。去年 12 月个人支出环比降 0.2%，预期降 0.4%，前值降 0.4%。

今日关注

1. 09:45 中国 1 月财新制造业 PMI
2. 15:30 瑞士 12 月实际零售销售年率
3. 16:50 法国 1 月制造业 PMI 终值
4. 16:55 德国 1 月制造业 PMI 终值
5. 17:00 欧元区 1 月制造业 PMI 终值
6. 17:30 英国 12 月央行抵押贷款许可
7. 17:30 英国 1 月制造业 PMI
8. 18:00 欧元区 12 月失业率
9. 22:45 美国 1 月 Markit 制造业 PMI 终值
10. 23:00 美国 1 月 ISM 制造业 PMI
11. 23:00 美国 12 月营建支出月率

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。

