

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

# 宏观市场每日全景分析报告

2022 年 2 月 10 日 星期四



	1 月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	4.0
官方制造业 PMI (%)	50.1	50.3
工业增加值同比 (%)	-	4.3
固定资产投资同比 (%)	-	4.9
社会消费品零售同比 (%)	-	1.7
出口同比 (%，按美元计)	-	20.9
进口同比 (%，按美元计)	-	19.5
CPI 同比 (%)	-	1.5
PPI 同比 (%)	-	10.3
新增贷款 (万亿)	-	1.13
新增社会融资规模 (万亿)	-	2.37
M1 同比 (%)	-	3.5
M2 同比 (%)	-	9.0

- 1、央行有关负责人解读“存取现金 5 万要登记”称，金融机构执行该规定不会影响居民正常现金存取款业务，业务便利程度亦不会受到影响。只有发现交易明显异常、有合理理由怀疑交易涉嫌洗钱等违法犯罪活动时，才会向客户进一步了解情况。目前我国超过 5 万元人民币的现金存取业务笔数仅占全部现金存取业务的 2% 左右，相关规定总体上看对客户办理现金业务影响较小。
- 2、国家发改委就价格过快上涨，接连约谈铁矿石资讯企业、煤炭企业。发改委、市场监管总局联合约谈有关铁矿石资讯企业，提醒告诫相关企业发布市场和价格信息前必须认真核实、做到准确无误，不得编造发布虚假价格信息，不得捏造散布涨价信息，不得哄抬价格；对于捏造散布涨价信息、哄抬价格等违法违规行，露头就打，严厉惩处。发改委、能源局召开会议部署煤炭保供稳价工作，并对监测发现的部分煤炭价格虚高企业进行约谈提醒，要求抓紧核查整改。
- 3、国家税务总局公告，将于 3 月 1 日至 6 月 30 日办理 2021 年度个人所得税综合所得汇算清缴。年度汇算需补税的纳税人，年度汇算期结束后未足额补缴税款的，税务机关将依法加收滞纳金，并在其《个人所得税纳税记录》中予以标注。

## 货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	1.7280	-31.60
7天 Shibor	2.0100	-7.70
14天 Shibor	1.9700	-6.20
1个月 Shibor	2.3950	-0.50

周三(2月9日)央行公开市场开展200亿元7天期逆回购操作,当日1500亿元逆回购到期,净回笼1800亿元。隔夜品种下行31.60bp报1.7280%。

## 外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
95.5588	6.3609	1.1423
-0.05% -0.45%,Ytd	-0.12% -0.20%,Ytd	0.05% 0.52%,Ytd



周三(2月9日)美元指数跌0.05%报95.5588,本周涨0.10%。欧元兑美元涨0.05%报1.1423,英镑兑美元跌0.10%报1.3534,澳元兑美元涨0.48%报0.7180,美元兑日元持平报115.5450,离岸人民币兑美元涨38个基点报6.3626。在岸人民币兑美元16:30收报6.3609,较前一交易日上涨79个基点,周涨27个基点。人民币兑美元中间价调贬84个基点,报6.3653。

 海外财经新闻

- 1、美联储博斯蒂克预计，美联储今年将加息三次，但他个人倾向于加息四次，预计每次加息幅度为 25 个基点。他还表示，希望尽快开始缩减资产负债表。
- 2、美联储 2022 年票委、克利夫兰联储主席梅斯特表示，美联储决策者以快于上轮加息周期的速度加息是合适的，因为现在通胀率要高得多，就业市场也比 2015 年紧张得多。她还表示，通胀风险依然偏向上行，但美联储最终加息路径和幅度将取决于经济发展。她预计今年晚些时候通胀会有所改善，前提是美联储采取适当行动。
- 3、德国央行新掌门人内格尔表示，如果 3 月通胀形势以及前景还没有明显好转，欧洲央行将不得不调整货币政策立场。第一步是在 2022 年停止资产净购买，然后在今年底之前加息。
- 4、日本央行审议委员中村丰明表示，除非物价指数稳定、工资上涨，否则日本央行货币政策不会调整。他预计日本 CPI 将继续回升，日本央行将持续采取宽松措施；并预计宽松措施将帮助日本提高增长潜能。
- 5、英国央行首席经济学家皮尔暗示央行不会很快抛售英国国债，称国债收益率 1%不是触发点，只是一个考虑的因素。英国央行此前在前瞻指引中称，一旦收益率达到 1%，会考虑“主动出售”国债。

 今日关注

1. 待定 欧佩克公布月度原油市场报告
2. 17:05 英国央行行长贝利发表讲话
3. 21:30 美国至 2 月 5 日当周初请失业金人数
4. 21:30 美国 1 月未季调 CPI 年率
5. 21:30 美国 1 月季调后 CPI 月率
6. 23:30 美国至 2 月 4 日当周 EIA 天然气库存

## 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。