

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11月8日 星期五



## 宏观经济

	10月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	4.9
官方制造业 PMI (%)	49.2	49.6
工业增加值同比 (%)	-	3.1
固定资产投资同比 (%)	-	7.3
社会消费品零售同比 (%)	-	4.4
出口同比 (%，按美元计)	27.1	28.1
进口同比 (%，按美元计)	20.6	17.6
CPI 同比 (%)	-	0.7
PPI 同比 (%)	-	10.7
新增贷款 (万亿)	-	1.66
新增社会融资规模 (万亿)	-	2.90
M1 同比 (%)	-	3.7
M2 同比 (%)	-	8.3

- 1、中共中央、国务院发布关于深入打好污染防治攻坚战的意见。意见指出，目标到2025年，生态环境持续改善，主要污染物排放总量持续下降，单位国内生产总值二氧化碳排放比2020年下降18%。深入推进碳达峰行动；推动能源清洁低碳转型，原则上不再新增自备燃煤机组，支持自备燃煤机组实施清洁能源替代；坚决遏制高耗能高排放项目盲目发展，重点区域严禁新增钢铁、焦化等产能；持续打好柴油货车污染治理攻坚战，有序推广清洁能源汽车。
- 2、中国10月出口（以人民币计）同比增长20.3%，前值19.9%；进口增14.5%，前值10.1%；贸易顺差5459.5亿元，前值4331.9亿元。中国10月出口（以美元计）同比增长27.1%，预期24.2%，前值28.1%；进口增20.6%，预期27%，前值17.6%；贸易顺差845.4亿美元，前值667.6亿美元。
- 3、部分支付宝用户“借呗”变为了“信用贷”，且明确提示由银行提供服务。对此，蚂蚁借呗方面回应称，借呗已启动品牌隔离工作，由蚂蚁消费金融公司提供的服务会继续显示“借呗”品牌，而银行等金融机构独立提供的信贷服务则会在“信用贷”页面展示，显著标识出金融机构信息，与借呗品牌相区隔。

## 货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	1.8870	0.10
7天 Shibor	2.1290	-0.50
14天 Shibor	2.2130	6.70
1个月 Shibor	2.3980	0.10

周五(11月5日)央行公开市场开展1000亿元7天期逆回购操作,当日有2000亿元逆回购到期。本周累计进行了22000亿元逆回购操作,累计有10000亿元逆回购到期,因此净回笼7800亿元。隔夜品种上行0.10bp报1.8870%。

## 外汇市场

美元指数 94.0244 -0.11% 4.71%,Ytd	美元兑人民币 6.4013 0.09% -2.19%,Ytd	欧元兑美元 1.1568 0.11% -5.23%,Ytd
-------------------------------------	--------------------------------------	-------------------------------------



周五(11月5日)美元指数跌0.11%报94.2241,本周跌0.10%。欧元兑美元涨0.11%报1.1568,英镑兑美元跌0.03%报1.3499,澳元兑美元涨0.23%报0.7447,美元兑日元跌0.31%报113.4000,离岸人民币兑美元涨29个基点报6.3944。在岸人民币兑美元16:30收报6.4013,较前一交易日下跌57个基点,周跌4个基点。人民币兑美元中间价调贬37个基点,报6.3980。



## 海外财经新闻

- 1、经过漫长博弈，美国联邦众议院上周五终于通过了《基础设施投资和就业法案》。根据该法案，在未来 5 年基建领域将新增投资约 5500 亿美元，包括 2180 亿美元道路桥梁、铁路、机场、港口升级维护支出；390 亿美元公交升级支出；1200 亿美元供水和宽带网络改造支出；1360 亿美元清洁能源、灾害治理、环境修复支出以及预计新建 50 万个充电桩的 75 亿美元支出。
- 2、美国去年有超过 1 万名患者在因其他原因入院后感染新冠病毒。然而，这个数字被很大程度地低估，因为该数据统计只包括除加利福尼亚州和佛罗里达州外的全部年龄段患者和其他州的 65 岁及以上患者。根据美国临床文件咨询公司创始人詹姆斯·肯尼迪对 2020 年 4 月 1 日至 9 月 30 日医疗保险记录的分析，美国平均约有 1.7% 的住院患者在医院感染了新冠病毒。而这些患者中有 21% 的人死亡。
- 3、美国总统拜登：基建法案投票对美国而言是“具有里程碑意义的一步”；基建投资将缓和通胀压力，会尽快举行法案签署仪式；基建法案将创造数以百万计的就业岗位，这其中大部分工作都不要大学学位；法案将提供资金建设 50 万个充电站。
- 4、澳洲联储货币政策声明：预计 2021 年底 GDP 增速为 3%，2022 年底 GDP 增速为 5.5%；预计 2021 年底平均通胀率为 2.25%，2022 年底为 2.25%；基于核心假设，首次加息可能在 2024 年，经济预测不支持 2022 年加息。
- 5、欧元区 9 月零售销售环比减 0.3%，预期增 0.3%，前值从增 0.3%修正为增 1%；同比增 2.5%，预期增 1.5%，前值从持平修正为增 1.5%。
- 6、德国 9 月工作日调整后工业产出同比降 1%，预期升 1.3%，前值升 1.7%；季调后工业产出环比降 1.1%，预期升 1%，前值自降 4%修正至降 3.5%。



## 今日关注

1. 14:45 瑞士 10 月季调后失业率
2. 17:30 欧元区 11 月 Sentix 投资者信心指数
3. 22:00 美联储副主席克拉里达发表讲话
4. 23:30 美联储主席鲍威尔在大会致辞

## 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。