

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8月5日 星期四

宏观经济

| | 7月实际值 | 前值 |
|---------------|-------|------|
| GDP 同比 (%) | - | 7.9 |
| 官方制造业 PMI (%) | 50.4 | 50.9 |
| 工业增加值同比 (%) | - | 8.3 |
| 固定资产投资同比 (%) | - | 12.6 |
| 社会消费品零售同比 (%) | - | 12.1 |
| 出口同比 (%，按美元计) | - | 32.2 |
| 进口同比 (%，按美元计) | - | 36.7 |
| CPI 同比 (%) | - | 1.1 |
| PPI 同比 (%) | - | 8.8 |
| 新增贷款 (万亿) | - | 2.12 |
| 新增社会融资规模 (万亿) | - | 3.67 |
| M1 同比 (%) | - | 5.5 |
| M2 同比 (%) | - | 8.6 |

- 1、针对化肥市场哄抬炒作、价格快速上涨的问题，市场监管总局根据举报线索，对涉嫌哄抬钾肥等化肥品种价格的生产和经销企业立案调查。国家发改委曾于7月底约谈提醒部分重点化肥企业，要求不得囤积居奇、哄抬价格或捏造、散布涨价信息。
- 2、中国7月财新服务业PMI为54.9，较6月的14个月低点大幅上升4.6个百分点，显示暑期来临及珠三角疫情结束后服务业快速反弹。服务业PMI的强劲增长抵消制造业PMI放缓的拖累，7月财新中国综合PMI录得53.1，较6月回升2.5个百分点，显示中国整体经济活动扩张加速。
- 3、国药集团中国生物杨晓明研究员团队最新发现，针对德尔塔变异株有效的单克隆抗体，中和活性IC50高达5ng/ml。康泰生物也表示，其获批紧急使用的新冠灭活疫苗对德尔塔等多种新冠变异株能够产生良好的中和反应。
- 4、7月上海新房开盘如火如荼，但网签系统突然无法正常使用，使得新盘交易突然陷入僵局，未能网签的客户或达到8000组以上。此次暂停网签恰好赶上上海的房贷利率上浮调整，这就意味着，即便未来搞定网签，也得每个月支付更多的房贷。

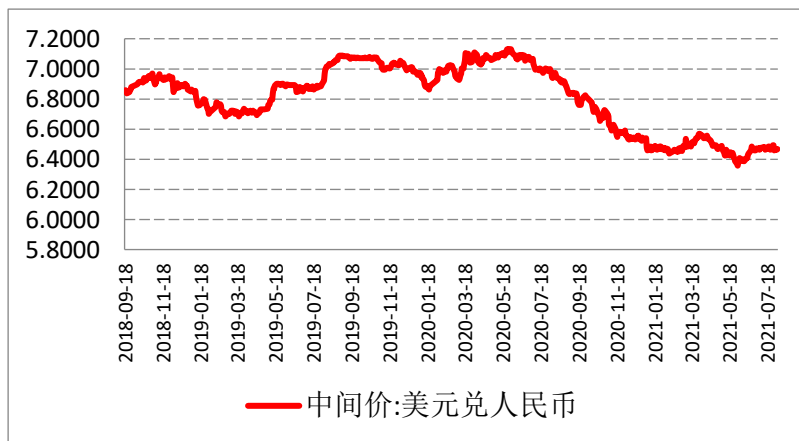
货币市场

| | 利率水平 | 较前一日变动 (bp) |
|------------|--------|----------------|
| 隔夜 Shibor | 1.7100 | -12.60 |
| 7天 Shibor | 2.0400 | -0.10 |
| 14天 Shibor | 2.0290 | -6.20 |
| 1个月 Shibor | 2.2950 | -0.80 |

周三（8月4日）央行公开市场开展100亿元7天期逆回购操作，当日100亿元逆回购到期，完全对冲到期量。隔夜品种下行12.60bp报1.7100%。

外汇市场

| 美元指数 | 美元兑人民币 | 欧元兑美元 |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| 92.2753 | 6.4619 | 1.1837 |
| 0.23% 2.60%,Ytd | -0.05% -1.30%,Ytd | -0.23% -2.67%,Ytd |



周三(8月4日)美元指数涨0.23%报92.2753,本周涨0.19%。欧元兑美元跌0.23%报1.1837,英镑兑美元跌0.19%报1.3889,澳元兑美元跌0.23%报0.7380,美元兑日元涨0.41%报109.4800,离岸人民币兑美元涨40个基点报6.4624。在岸人民币兑美元16:30收报6.4619,较前一交易上涨30个基点,周跌59个基点。人民币兑美元中间价调贬45个基点,报6.4655。



海外财经新闻

- 1、美联储副主席克拉里达表示，很可能在明年年底前达到其经济目标，并在 2023 年开始再次加息。他预计推动物价上涨的供需失衡随着时间推移将消散，而通胀预期将保持稳定。但他认为通胀前景的风险是上行。
- 2、美联储卡普兰：美联储应该很快开始逐步缩减债券购买规模；预计缩减购债规模需要大约 8 个月时间；缩减购债可能意味着每月美国国债购买规模减少 100 亿美元，抵押贷款支持证券减少 50 亿美元；更快的减码 QE 并不意味着美联储会更快地加息。
- 3、美联储布拉德表示，美国的通胀将是暂时的，但“将比大多数人的预期更为持久”，并预计 2022 年会在 2.5%至 3%之间。布拉德称，未来可能有通胀风险，他认为美联储没有必要继续进行购买操作。
- 4、美国 7 月 ADP 就业人数仅新增 33 万，创 2 月以来新低，远不及预期的增 68.3 万，前值为 69.2 万。数据表明，尽管经济整体改善，但招聘障碍依然存在，这也凸显出劳动力市场全面复苏面临挑战。
- 5、欧元区 7 月服务业 PMI 终值录得 59.8，为 2008 年以来最高水平，预期为 60.4，初值为 60.4；综合 PMI 终值录得 60.2，预期为 60.6，前值为 60.6。



今日关注

1. 待定 英国央行行长贝利召开新闻发布会
2. 14:45 法国 6 月工业产出月率
3. 15:00 国务院联防联控机制召开新闻发布会
4. 19:00 英国央行公布利率决议以及会议纪要
5. 19:30 美国 7 月挑战者企业裁员人数
6. 20:30 美国至 7 月 31 日当周初请失业金人数
7. 20:30 美国 6 月贸易帐
8. 22:00 美联储理事沃勒发表讲话
9. 22:30 美国至 7 月 30 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。