

# 非美货币普遍上涨，美元指数 小幅下跌

撰写人：宏观团队、股指团队

所属部门：浙商期货研究中心

日期：2022年8月9日

## 报告导读

### 宏观结论

地缘政治影响消退提振风险偏好，赚钱效应好转以及新成立基金份额较高表明资金情绪回暖，期指建议 IC2212、IM2212 多单入场。当前十年期国债收益率为 2.7395，期债观望。黄金观望。

### 股指

#### 市场综述:

周一两市早盘震荡走高，沪指、深成指由绿翻红，创指盘中一度跌超 1%，随后跌幅收窄。沪指、深成指午后一度翻绿，创业板指继续弱势徘徊。总体而言，行业间分化加大，个股涨多跌少，赚钱效应较差

### 债市

#### 市场综述:

8月8日，国债期货小幅收跌，10年期主力合约跌 0.02%，5年期主力合约跌 0.02%，2年期主力合约跌 0.01%。资金面宽松，Shibor 短端品种多数下行。隔夜品种下行 0.6bp 报 1.013%，7 天期上行 0.7bp 报 1.391%，14 天期下行 2.9bp 报 1.322%，1 个月期下行 2.5bp 报 1.569%

### 黄金

#### 市场综述:

隔夜 COMEX 期金开于 1790.3 收于 1805.5。美联储将基准利率上调 75 个基点至 2.25%至 2.50%区间，符合市场预期。美联储主席鲍威尔称，另一次大幅加息取决于数据。上周 SPDR 黄金持仓量减少 0.67%至 999.16 吨

## 宏观摘要

### 国外方面:

1. 美国三大股指收盘涨跌不一
2. 美债收益率多数下跌
3. 日本6月贸易帐逆差11139亿日元
4. 纽约尾盘, 美元指数跌0.18%报106.38

### 国内方面:

5. 工信部等四部门印发《推进家居产业高质量发展行动方案》
6. 交通运输部对《自动驾驶汽车运输安全服务指南(试行)》征求意见
7. 中央气象台继续发布高温橙色预警
8. 保障性租赁住房REITs项目落地加速
9. 中国证券业协会发布的《2021年度证券公司投资者服务与保护报告》

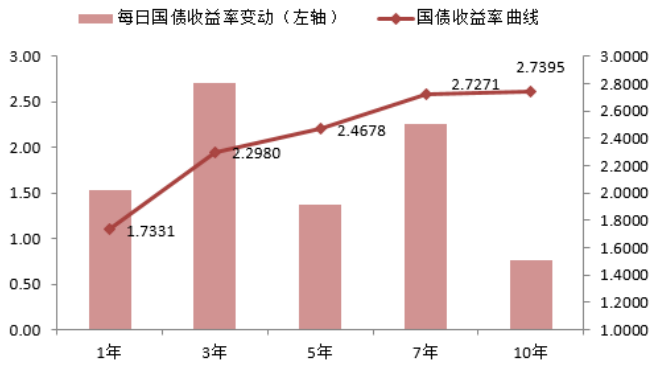
## 今日提示

- 16:00 中国7月社会融资规模-单月(亿人民币)
- 16:00 中国7月M2货币供应年率(%)
- 18:00 加拿大7月先行指标月率(%)

## 市场要点

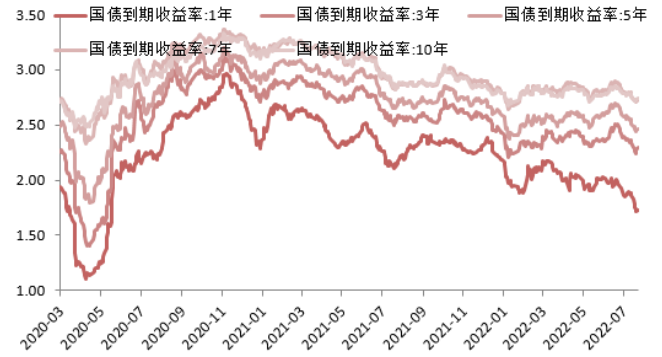
1. **美国三大股指收盘涨跌不一**，道指涨 0.09%报 32832.54 点，标普 500 指数跌 0.12%报 4140.06 点，纳指跌 0.1%报 12644.46 点。迪士尼涨 2.32%，陶氏涨 1.3%，领涨道指。万得美国 TAMAMA 科技指数跌 0.29%，亚马逊跌 0.99%，特斯拉涨 0.78%。中概股涨跌互现，中阳金融涨 102.66%，尚乘数科跌 43%。
2. **美债收益率多数下跌**，3 月期美债收益率涨 2.55 个基点报 2.519%，2 年期美债收益率跌 1.8 个基点报 3.218%，3 年期美债收益率跌 3.1 个基点报 3.147%，5 年期美债收益率跌 4.9 个基点报 2.914%，10 年期美债收益率跌 7 个基点报 2.762%，30 年期美债收益率跌 8.3 个基点报 2.988%。
3. **日本 6 月贸易帐逆差 11139 亿日元**，预期逆差 9859 亿日元，前值逆差 19512 亿日元。日本 6 月季调后经常账盈余 8383 亿日元，预期赤字 276 亿日元，前值盈余 82 亿日元。
4. **纽约尾盘，美元指数跌 0.18%报 106.38**，非美货币普遍上涨，欧元兑美元涨 0.14%报 1.0197，英镑兑美元涨 0.08%报 1.2080，澳元兑美元涨 1.07%报 0.6984，美元兑日元跌 0.03%报 134.96，美元兑瑞郎跌 0.68%报 0.9554，离岸人民币兑美元涨 48 个基点报 6.7624。
5. **工信部等四部门印发《推进家居产业高质量发展行动方案》**提出，到 2025 年，家居产业创新能力明显增强，高质量产品供给明显增加。在家用电器、照明电器等行业培育制造业创新中心、数字化转型促进中心等创新平台；重点行业两化融合水平达到 65%；反向定制、全屋定制、场景化集成定制等个性化定制比例稳步提高。
6. **交通运输部对《自动驾驶汽车运输安全服务指南（试行）》征求意见**，拟对包括公交车、出租车、道路客运、道路货运在内的自动驾驶车辆，做出服务规范要求。意见稿提出，鼓励封闭式 BRT 使用自动驾驶公交车；在交通状况简单、条件相对可控的场景使用自动驾驶出租车；审慎使用自动驾驶汽车从事道路客运。
7. **中央气象台继续发布高温橙色预警**，预计 8 月 9 日白天，新疆南疆盆地和吐鲁番、陕西中南部、河南南部、安徽、江苏、上海、四川东部、重庆、湖北、湖南、江西、浙江、福建、广西中北部、广东北部等地有 35~39℃高温天气，其中，陕西东南部、湖北西北部、重庆西部和北部、江苏南部及新疆吐鲁番等地局地可达 40℃或以上。
8. **保障性租赁住房 REITs 项目落地加速**。红土创新深圳安居房 REIT 询价结果出炉，认购价格为 2.484 元/份，将于 8 月 16 日起公开发售。中金厦门安居 REIT 完成询价定价，最终认购价格为 2.6 元/份。
9. 据证券时报，**中国证券业协会发布的《2021 年度证券公司投资者服务与保护报告》**显示，截至 2021 年底，我国基金投资者超过 7.2 亿。而十年前，基金户数还不到 4000 万，十年间，公募基金投资者数量增加了 17 倍。十年间，公募基金累计为持有人创造了 6.25 万亿元的回报，向持有人累计分红 1.2 万亿元。

图 1:国债收益率历史走势



资料来源:Wind, 浙商期货研究中心

图 2:国债收益率曲线和每日变动



资料来源:Wind, 浙商期货研究中心

**免责声明：**

本报告版权归“浙商期货”所有，未经事先书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“浙商期货”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。本报告基于我公司及其研究人员认为可信的公开资料或实地调研资料，但我公司及其研究人员对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。报告中的信息或所表达意见不构成投资、法律、会计或税务的最终操作建议，我公司不就报告中的内容对最终操作建议做出任何担保。我公司的关联机构或个人可能在本报告公开发布前已使用或了解其中信息。