

美联储官员继续放鹰，风险资产再度承压

东海期货 | 宏观日报 2022 年 8 月 31 日

研究所 宏观策略组

宏观日报

贾利军

从业资格证号：F0256916
投资分析证号：Z0000671
联系电话：021-68757181
邮箱：jialj@qh168.com.cn

明道雨 联系人

联系电话：021-68758120

1、宏观重要消息及事件：

纽约联储主席威廉姆斯与亚特兰大联储主席博斯蒂克认为，美联储的政策收紧工作还远未结束。威廉姆斯表示，需要几年时间才能恢复到 2% 的通胀率，美联储需要在明年继续加息并让联邦基金利率长期高于中性水平（略高于 3.5%）。而此后加息的幅度将由未来发布的通胀数据决定，美联储明年将在一段时间内实施限制性政策。与此同时，本周起美联储缩表将“全速前进”，这会减少市场流动性。

欧洲央行管委诺特称，市场对 9 月份加息的定价并非不明智。诺特与另一位管委穆勒倾向于 9 月加息 75 个基点。欧洲央行管委温施称欧洲可能正走向技术性衰退，甚至更糟。欧洲央行管委内格尔则表示，欧洲央行不应该因为担心经济衰退而推迟加息。

美国国务院发言人回应美国记者称，伊朗媒体有关“伊朗和美国已经就重启《联合全面行动计划》(JCPOA) 达成协议，将在未来两到三周内宣布”的消息是错误的。美国国务院称还没有达成谅解。

伊拉克安全部队决定取消全国宵禁。伊拉克国家石油营销组织 SOMO 表示，伊拉克石油出口业务不受“绿区”冲突影响，准备增加对欧洲的石油出口。

德国总理朔尔茨称已对冬季能源危机做好准备。据外媒报道，德国政府可能考虑对欧洲天然气设置价格上限。欧洲天然气基准价格一度下跌 11% 至 242 欧元/兆瓦时。欧盟委员会主席冯德莱恩称，欧盟电力市场已停摆。

财政部发布上半年中国财政政策执行情况报告，指出下一步将加大宏观政策调节力度，谋划增量政策工具，靠前安排、加快节奏、适时加力，继续做好“六稳”、“六保”工作，持续保障改善民生，保持经济运行在合理区间。

商务部表示，将抓紧出台新一批的稳外资政策措施。包括加紧推出新版的《鼓励外商投资产业目录》，进一步扩大先进制造、科技创新、现代服务等领域鼓励外商投资的范围。

2、全球资产价格走势

	上一日收盘	前值	变动
国内外商品期货方面			
布伦特原油	98.47	102.95	-4.35%
WTI 原油	92.25	94.77	-2.66%
COMEX 黄金	1735.7	1749.5	-0.79%
COMEX 白银	18.29	18.66	-1.98%
LME 铜	7854.5	8129	-3.38%
LME 铝	2384	2428	-1.81%
LME 锌	3472	3562	-2.53%
螺纹	3661	3965	-7.67%
铁矿	682	714	-4.48%
全球主要股票市场			
上证指数	3227.22	3240.73	-0.42%
恒生指数	19949.03	20023.22	-0.37%
日经 225 指数	28195.58	27878.96	1.14%
道琼斯工业平均指数	31790.8691	32098.9902	-0.96%
法国 CAC40 指数	6210.22	6222.28	-0.19%
德国法兰克福指数	12961.14	12892.99	0.53%
英国富时 100 指数	7361.63	7427.31	-0.88%

数据来源：文华财经，东海期货研究所整理

3、国内流动性概况

	上一日收盘	前值	变动 (BP)
SHIBORO/N	1.12	1.24	-11
SHIBOR1W	1.65	1.64	1
SHIBOR3M	1.60	1.60	0
R007	1.79	1.79	0
DR007	1.66	1.62	4

数据来源：Wind，东海期货研究所整理

4、重要财经日历

- 1、09:30 中国 8 月官方制造业 PMI
- 2、14:45 法国第二季度 GDP 年率终值
- 3、15:55 德国 8 月季调后失业率
- 4、17:00 欧元区 8 月 CPI 年率初值及月率
- 5、20:00 美联储梅斯特发表讲话
- 6、20:15 美国 8 月 ADP 就业人数

免责声明：

本报告立足于结合基本面及技术面对市场价格运行趋势及轮廓进行整体判断，提示可能存在的投资风险与投资机会。报告中的信息均源自于公开材料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。报告仅作参考之用，在任何情况下均不构成对所述期货品种的买卖建议，我们也不承担因根据本报告操作而导致的损失。

联系方式：

公司地址：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 层

邮政编码：200125

公司网址：www.qh168.com.cn