

## 美元指数创二十年新高，大宗商品价格全面下跌

东海期货 | 宏观日报 2022 年 9 月 2 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:

美联储博斯蒂克称美联储的政策旨在放缓经济，距离将通胀降至 2% 还有很长一段路要走。美国上周首次申领失业金人数为 23.2 万人，好于预期。亚特兰大联储 GDPNow 模型对美国第三季度 GDP 增速的预期升至 2.6%。

在周三公布的通胀数据创纪录新高后，欧元区货币市场目前预计，欧洲央行加息 75 个基点的可能性约为 80%。利率预期的上升推动欧元区各国政府债券收益率大幅走高，意大利 10 年期国债收益率自 6 月以来首次突破 4%。

欧元区 8 月制造业 PMI 终值录得 49.6，为 2020 年 6 月以来新低，初值为 49.7。德国 8 月制造业 PMI 终值为 49.1，同样创 2020 年 6 月以来新低，初值 49.8。法国 8 月制造业 PMI 终值为 50.6，初值为 49。

美国 8 月 ISM 制造业 PMI 持平于 52.8，高于市场预期，但仍处于两年多地位。原材料成本指标连续第五个月下降，表明通胀压力正在减弱。就业指数升至 54.2 的 5 个月高点。

欧盟官员称，欧盟正在考虑制定能源价格上限，考虑对能源公司征收暴利税，也可能会采取措施减少电力需求。此外，欧盟委员会还在考虑改革欧盟电力市场的设计。

据伊朗国家媒体：伊朗方面对美国旨在恢复核协议的提议作出了“建设性”回应，伊朗的回应“旨在完成谈判”。美国国会两党小组因担忧“恐怖主义制裁”相关制裁可能减弱而对可能达成的伊核协议发出警告。

国家发改委价格司指导各地 9 月份加大政府猪肉储备投放力度，与国家投放中央猪肉储备工作形成合力。目前各地正按照工作部署，积极准备投放猪肉储备。

商务部回应“美国限制英伟达向中国出售两款芯片”表示，一段时间以来，美方不断滥用出口管制措施，限制半导体相关物项对华出口，中方对此坚决反对。

中国 8 月财新制造业 PMI 为 49.5，较 7 月回落 0.9 个百分点，降至荣枯线以下，显示制造业在经历两个月扩张后重现收缩。

## 2、全球资产价格走势

|                  | 上一日收盘      | 前值         | 变动     |
|------------------|------------|------------|--------|
| <b>国内外商品期货方面</b> |            |            |        |
| 布伦特原油            | 92.23      | 94.96      | -2.87% |
| WTI 原油           | 86.34      | 87.85      | -1.72% |
| COMEX 黄金         | 1709       | 1722.7     | -0.80% |
| COMEX 白银         | 17.69      | 17.865     | -0.98% |
| LME 铜            | 7550       | 7790.5     | -3.09% |
| LME 铝            | 2305       | 2363       | -2.45% |
| LME 锌            | 3247       | 3463       | -6.24% |
| 螺纹               | 3642       | 3677       | -0.95% |
| 铁矿               | 675.5      | 685        | -1.39% |
| <b>全球主要股票市场</b>  |            |            |        |
| 上证指数             | 3184.98    | 3202.14    | -0.54% |
| 恒生指数             | 19597.31   | 19954.39   | -1.79% |
| 日经 225 指数        | 27661.47   | 28091.53   | -1.53% |
| 道琼斯工业平均指数        | 31656.4199 | 31510.4297 | 0.46%  |
| 法国 CAC40 指数      | 6034.31    | 6125.1     | -1.48% |
| 德国法兰克福指数         | 12630.23   | 12834.96   | -1.60% |
| 英国富时 100 指数      | 7148.50    | 7284.15    | -1.86% |

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 | 1.46  | 1.40 | 6       |
| SHIBOR1W  | 1.50  | 1.78 | -28     |
| SHIBOR3M  | 1.60  | 1.60 | 0       |
| R007      | 1.56  | 1.69 | -13     |
| DR007     | 1.43  | 1.72 | -29     |

数据来源：Wind，东海期货研究所整理

## 4、重要财经日历

- 1、待定 G7 财长和央行行长会议举行
- 2、17:00 欧元区 7 月 PPI 月率
- 3、20:30 美国 8 月失业率
- 4、20:30 美国 8 月季调后非农就业人口
- 5、22:00 美国 7 月工厂订单月率

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](http://www.qh168.com.cn)