

美元指数大幅走强，风险资产承压下跌

东海期货 | 宏观日报 2022 年 9 月 7 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:

特拉斯接受英国女王任命，正式成为英国首相。特拉斯认为，英国现在面临严重的全球性挑战，现在是时候解决阻碍英国发展的问题了。特拉斯的能源应对计划将耗资约 2000 亿美元。英国前财政大臣表示，特拉斯的能源援助计划恐将推高英国政策利率。

欧洲央行管委斯图纳拉斯认为，欧元区的通胀已经接近峰值，欧洲央行进一步实现利率正常化是合适的。欧洲央行管委 Kazaks 却表示，广泛而持久的衰退可能会迫使欧洲央行减缓加息。Kazaks 称，如有必要，欧洲央行将加息至中性利率以上。而与欧洲央行会议日期挂钩的掉期交易显示，货币市场降低了对欧央行的加息预期，对欧洲央行利率押注显示加息 75 个基点远未成定局。

美国 8 月 Markit 服务业 PMI 终值录得 43.7，预期为 44.2，前值为 44.1，创 2020 年 6 月以来新低。得益于需求回暖，美国 8 月 ISM 非制造业 PMI 录得 56.9，预期为 55.1，前值为 56.7，为四个月新高。

美国财政部副部长 Adeyemo 在采访时表示，美国将把初步的对俄石油限价措施“指导价”设定为 44 美元/桶，这是此前俄罗斯自己给出的每桶石油成本价估计。俄罗斯能源部长称，将通过向亚洲运送更多石油来应对针对俄罗斯石油的价格上限。

俄罗斯能源部长谈北溪 1 号天然气管道恢复运行问题称，尚未作出任何决定，我们正在等待。俄罗斯天然气工业股份公司（俄气）副首席执行官 Markelov 表示，在西门子能源公司修复故障设备之前，北溪 1 号不会启动。俄气称，北溪 1 号管道设备故障有爆炸风险。

国家主席主持召开中央全面深化改革委员会第二十七次会议强调，健全关键核心技术攻关新型举国体制，全面加强资源节约工作。

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	92.91	95.22	-2.43%

WTI 原油	86.92	87.84	-1.05%
COMEX 黄金	1711.4	1722.6	-0.65%
COMEX 白银	17.88	17.91	-0.17%
LME 铜	7666	7674	-0.10%
LME 铝	2260.5	2288	-1.20%
LME 锌	3181.5	3194	-0.39%
螺纹	3693	3691	0.05%
铁矿	691.5	692	-0.07%
全球主要股票市场			
上证指数	3243.45	3199.91	1.36%
恒生指数	19202.73	19225.70	-0.12%
日经 225 指数	27626.51	27619.61	0.02%
道琼斯工业平均指数	31145.3008	31318.4395	-0.55%
法国 CAC40 指数	6104.61	6093.22	0.19%
德国法兰克福指数	7300.44	7287.43	0.18%
英国富时 100 指数	12871.44	12760.78	0.87%

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	1.07	1.03	4
SHIBOR1W	1.45	1.41	4
SHIBOR3M	1.60	1.60	0
R007	1.54	1.55	-1
DR007	1.40	1.35	5

数据来源：Wind，东海期货研究所整理

4、重要财经日历

- 1、10:00 中国 8 月贸易帐
- 2、16:00 中国 8 月外汇储备
- 3、17:00 欧元区第二季度 GDP 年率终值
- 4、20:30 美国 7 月贸易帐
- 5、22:00 美联储梅斯特发表讲话
- 6、22:00 加拿大央行公布利率决议
- 7、22:00 美国 8 月纽约联储全球供应链压力指数
- 8、23:55 美联储副主席布雷纳德发表讲话
- 9、24:00 EIA 公布月度短期能源展望报告
- 10、次日 00:35 美联储副主席布雷纳德发表讲话
- 11、次日 02:00 美联储公布经济状况褐皮书

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