

美联储议息会议整体偏鹰，风险资产大幅回调

东海期货 | 宏观日报 2022 年 11 月 03 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：

美联储公布 11 月利率决议，连续第四次加息 75 个基点，暗示 12 月可能放缓加息步伐。鲍威尔称终端利率将高过此前预期，暂停加息为时过早，最快 12 月放慢加息，未来聚焦 CPI 数据。截至今晨，市场预测美联储 12 月加息 75 个基点的概率为 25% 左右，将在明年 5 月达到本轮加息的终端利率 5.08%。白宫在美联储公布利率决议的前几分钟突然表态支持美联储的独立性，并认为美联储的政策能够控制住通胀。

继周三公布的 JOLTS 职位空缺数据意外录得增加，美国 10 月 ADP 就业人数新增 23.9 万人，好于预期，显示劳动力市场有所改善。

俄罗斯 2 日恢复参与黑海粮食协议，CBOT 小麦期货跌停。俄防长绍伊古表示从 11 月 2 日开始恢复黑海港口农产品外运工作。普京表示俄罗斯保留再次退出协议的权利。俄罗斯将于 11 月 18 日前决定是否延长粮食协议。

俄罗斯外交部发布了阻止核战争发生的声明。就英国专家参与指导乌克兰对俄罗斯袭击一事，俄罗斯外交部将召见英国驻俄罗斯大使。“北溪”运营公司已完成第一条受损管道的信息搜集工作。英国将制裁俄罗斯钢铁和石油化工巨头。

伊朗外长同欧盟官员就伊核协议相关谈判通电话。伊朗表示已准备好达成一项良好、有力和稳定的协议。欧盟方面表示，将继续其建设性努力，直到各方达成最终协议。欧盟委员会副主席兼“外长”博雷利表示，“我们对结果持乐观态度”。伊朗外交部：西方宣布伊朗“即将”打击沙特阿拉伯，是在蓄意煽动反对伊朗的气氛。

欧元区 10 月 PMI 终值下修至 46.4，创 29 个月新低，且连续四个月低于荣枯线，表明生活成本危机严重削弱了需求，欧洲制造业已处在衰退之中。

国家卫健委：要慎终如始抓实抓细新冠肺炎疫情防控，毫不动摇坚持“外防输入、内防反弹”总策略和“动态清零”总方针，坚决落实“四早”要求，努力以最小范围、最短时间、最低成本控制住突发疫情。

国家市场监督管理总局批准中国联通与腾讯设立混改新公司。接近中国联通的人士表示，联通与腾讯设立混改新公司 不涉及母

公司股权变更。

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	95.59	94.77	0.87%
WTI 原油	89.32	87.21	2.42%
COMEX 黄金	1637.8	1651	-0.80%
COMEX 白银	19.22	19.625	-2.06%
LME 铜	7640	7660	-0.26%
LME 铝	2250	2257	-0.31%
LME 锌	2764.5	2762	0.09%
螺纹	3485	3485	0.00%
铁矿	629	628	0.16%
全球主要股票市场			
道琼斯工业平均指数	32147.76	32653.20	-1.55%
恒生指数	15827.17	15455.27	2.41%
日经 225 指数	27663.39	27575.00	0.32%
上证指数	3003.37	2969.2	1.15%
法国 CAC40 指数	6276.88	6328.25	-0.81%
英国富时 100 指数	7144.14	7186.16	-0.58%
德国法兰克福指数	13256.74	13338.74	-0.61%

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	1.76	1.84	-9
SHIBOR1W	1.77	1.83	-6
SHIBOR3M	1.75	1.75	0
R007	1.79	1.93	-15
DR007	1.71	1.74	-3

数据来源：Wind，东海期货研究所整理

4、重要财经日历

- 1、16:05 欧洲央行行长拉加德发表讲话
- 2、18:00 欧元区 9 月失业率
- 3、20:00 英国央行公布利率决议和会议纪要
- 4、20:30 英国央行行长贝利召开新闻发布会
- 5、21:45 美国 10 月 Markit 服务业 PMI 终值
- 6、22:00 美国 10 月 ISM 非制造业 PMI
- 7、22:00 美国 9 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