

2023年02月10日

美债收益率大幅上升，全球风险偏好继续降温

——宏观金融日报

分析师

贾利军

从业资格证号：F0256916

投资咨询证号：Z0000671

电话：021-68757181

邮箱：jialj@qh168.com.cn

联系人

明道雨

从业资格证号：F03092124

电话：021-68758120

邮箱：mingdy@qh168.com.cn

顾森

从业资格证号：F3082395

电话：021-68757223

邮箱：gus@qh168.com.cn

刘晨业

从业资格证号：F3064051

电话：021-68757223

邮箱：liucy@qh168.com.cn

宏观：美债收益率大幅上升，全球风险偏好继续降温

1.宏观重要消息及事件：

美联储巴尔金称：美联储需要在控制通胀方面“坚持到底”。虽然平均通胀率已经达到峰值，但下降幅度被一些商品扭曲了，中值“保持在高位”。2023年的核心问题是通胀是否真的稳定下来。不能理所当然地认为过去三个月的通胀下降能持续，抗击通胀任重道远。

美国至2月4日当周初请失业金人数录得19.6万人，为2023年1月7日当周以来新高。债市向美联储的预期管理靠拢，美国2年期国债收益率自去年11月30日以来首次突破4.5%。

在2月9日商务部举行的例行新闻发布会上，在回答关于美国政府已停止批准美国公司向华为出口大多数产品许可证的相关问题时，新闻发言人束珏婷表示，中方将坚定维护中国企业正当合法权益。

商务部新闻发言人束珏婷表示，中方注意到美方近日发布的所谓恶名市场名单，中方认为，报告引述的情况未经调查核实，结论是不客观、不公正的。美方将中国一些企业和市场列入了名单，中方对此坚决反对。

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	84.08	85.02	-1.11%
WTI 原油	77.63	78.82	-1.51%
COMEX 黄金	1877.3	1888.1	-0.57%
COMEX 白银	22,075	22,345	-1.21%
LME 铜	9000.5	8921.5	0.89%
LME 铝	2507	2487.5	0.78%
LME 锌	3147.5	3137.5	0.32%
螺纹	4085	4055	0.74%
铁矿	863	848	1.77%
全球主要股票市场			
道琼斯工业平均指数	33699.88	33949.01	-0.73%
恒生指数	21624.36	21283.52	1.60%
日经 225 指数	27584.35	27606.46	-0.08%
上证指数	3270.3826	3232.1063	1.18%
法国 CAC40 指数	7188.36	7119.83	0.96%
英国富时 100 指数	7911.15	7885.17	0.33%

德国法兰克福指数	15523.42	15412.05	0.72%
----------	----------	----------	-------

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)
SHIBOR/N	2.32	2.37	-5
SHIBOR1W	2.20	2.19	0
SHIBOR3M	2.37	2.37	0
R007	2.47	2.61	-14
DR007	2.21	2.24	-3

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1月CPI年率
- 2、15:00 英国第四季度GDP年率修正值
- 3、23:00 美国2月一年期通胀率预期
- 4、23:00 美国2月密歇根大学消费者信心指数初值

风险提示

本报告中的信息均源自于公开资料，我司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，在任何情况下本报告亦不构成对所述期货品种的买卖建议。市场有风险，投资需谨慎。

免责条款

本报告内容所涉及信息或数据主要来源第三方信息提供者或者其他公开信息，东海期货不对该类信息或者数据的准确性及完整性做任何保证。本报告仅反映研究员个人出具本报告当时的分析和判断，并不代表东海期货有限责任公司，或其任何附属公司的立场，公司可能发表其他与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。本报告可能因时间等因素的变化而变化从而导致与事实不完全一致，敬请关注本公司就同一主题所出具的相关后续研究报告及评论文章。

在任何情况下，本报告中的信息或所表述的意见并不构成对任何人的投资建议，也未考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需求。客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况，若有必要应征求专家意见。本报告所载的资料、工具、意见及推测只提供给客户作参考之用，并非作为或被视为出售或购买投资标的的邀请或向人作出邀请。

在任何情况下，本公司不对任何人因使用本报告中的任何内容所导致的任何损失负任何作用，投资者需自行承担风险。

本报告版权归“东海期货有限责任公司”所有，未经本公司书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的翻版、复制、刊登、发表或者引用。

东海期货有限责任公司研究所

地址：上海市东方路1928号东海证券大厦8F

联系人：贾利军

电话：021-68757181

网址：www.qh168.com.cn

E-MAIL: Jialj@qh168.com.cn