

大类资产监测日报 (20230310)

一、宏观要点关注

- 中国2月CPI同比涨幅由上月的2.1%大幅回落至1%，且明显低于市场预期的涨1.8%，环比则下降0.5%。PPI同比下降1.4%，基本符合预期，环比则持平。统计局表示，CPI增速的回落主要是受节后消费需求回落、市场供应充足等因素影响。
- 美国总统拜登公布2024财年预算，预算总规模接近6.9万亿美元。拜登提议油气公司的企业税率从21%升至28%，国防预算增长3.2%，联邦雇员薪资提高5.2%。预算案预计美国2024年GDP同比增长1.5%，失业率为4.6%，CPI为2.4%
- 欧洲央行管委维勒鲁瓦表示，预计通胀将在今年6月见顶，到2024年底或2025年初，将使通胀回到2%的水平。

二、海外市场

10Y国债				美元及大宗商品			
2023-03-09	收益率	日涨跌 (BP)	年初至今涨跌 (BP)	2023-03-09	收盘价	日涨跌	年初至今涨跌幅
美国	3.93	-5.00	14.00	COMEX黄金	1835.00	0.90%	0.48%
日本	0.00	-52.90	-49.10	Brent原油	82.52	0.00%	-3.95%
德国	2.69	0.00	21.00	伦铜	8810.00	0.00%	5.06%
意大利	4.39	4.42	4.54	美豆	1513.25	-0.30%	-0.71%
法国	3.14	3.14	3.19	美元指数	105.24	-0.43%	1.69%
主要国家股指				美联储加息概率			
2023-03-09	收盘价	日涨跌幅	年初至今涨跌幅	3月8日数据	5%-5.25%	5.25%-5.5%	5.5%-5.75%
标普500	3918.32	-1.85%	2.05%	3月22日	60.20%	-	-
日经225	28623.15	0.63%	9.69%	5月3日	-	54.60%	-
德国DAX	15633.21	0.01%	12.28%	6月14日	-	-	45.20%
富时A50	13118.81	-0.61%	0.88%	7月26日	-	-	43.50%
恒生指数	19925.74	-0.63%	0.73%	9月20日	-	-	42.50%
恒生国企指数	6649.63	-1.15%	-0.82%	11月1日	-	-	34.60%
AH溢价指数	145.14	0.99%	2.16%	12月13日	-	-	34.60%

三、国内市场

1、商品市场

国内商品							
	2023-03-09	日涨跌	近一周涨跌幅	近一月涨跌幅	近一季度涨跌	近一年涨跌	年初值
南华综合指数	2394.07	-0.08%	-1.10%	1.33%	4.65%	6.45%	2,377
南华工业品指数	3941.58	-0.14%	-1.06%	1.39%	5.35%	8.14%	3,875
南华农产品指数	1118.24	-0.56%	-1.50%	0.91%	0.07%	-3.76%	1,127
南华金属指数	6521.65	0.43%	-0.48%	0.42%	0.42%	0.42%	6,439
南华能化指数	1930.65	-0.70%	-1.72%	1.77%	5.56%	2.83%	1,902
南华贵金属指数	678.1	0.01%	-1.48%	-0.78%	-1.76%	1.36%	712

2、股票及期货市场表现

股票市场				债券收益率			
2023-03-09	收盘价	日涨跌幅	年初至今涨跌幅	10年期国债	企业债(AAA):10年	信用利差	
上证指数	3276.09	-0.22%	6.05%	2023-03-09	2.8731	3.6053	73.22
沪深300	4019.85	-0.35%	3.83%	2023-03-08	2.8804	3.6168	73.64
上证50	2671.84	-0.75%	1.39%	2023-03-07	2.8729	3.6307	75.78
中证500	6285.95	-0.25%	7.19%	2023-03-06	2.8828	3.6305	74.77
创业板	2372.68	-0.21%	1.10%	2023-03-03	2.9109	3.6273	71.64
融资融券							
	2023-03-01	2023-03-02	2023-03-03	2023-03-06	2023-03-07	2023-03-08	
深市(亿)	8405	8396	8396	8428	8414	8422	
沪市(亿)	7454	7466	7443	7474	7449	7452	
深市+沪市(亿)	15859	15862	15840	15902	15863	15874	
沪港通当日投资额(单位:亿元)							
	2023-3-1	2023-3-2	2023-3-3	2023-3-6	2023-3-7	2023-3-8	2023-3-9
北向资金(陆股通)	29.92	64.29	19.81	20.03	-6.85	67.07	5.46
南向资金(港股通)	70.10	7.65	20.66	0.76	-1.88	-10.14	-41.76

3、货币市场及央行公开市场操作

香港货币市场							
	2023-03-03	2023-03-06	2023-03-07	2023-03-08	2023-03-09	日涨跌 (BP)	周涨跌 (BP)
SHIBOR:隔夜	1.29	1.23	1.44	1.65	1.37	-27.50	8.20
SHIBOR:1周	1.93	1.82	1.87	1.92	1.92	0.60	-1.00
HIBOR:隔夜	2.00	1.96	2.01	2.03	2.16	13.20	15.74
HIBOR:1周	2.40	2.39	2.37	2.35	2.40	4.54	-0.21
人民币外汇市场							
	2023-03-03	2023-03-06	2023-03-07	2023-03-08	2023-3-9	日涨跌 (BP)	年初至今涨跌幅
USDCNY	6.9117	6.8951	6.9156	6.9525	6.9666	-7	0.27%
USDCNH	6.8972	6.9503	6.9941	6.9682	6.9762	80	0.80%
公开市场操作							
	2023-01-27	2023-02-03	2023-02-10	2023-02-17	2023-02-24	2023-03-03	
净投放量	0	12,430	18,400	16,620	14,900	10,200	
投放量	6,980	23,110	12,380	18,400	16,620	14,950	
回笼量	-6,980	-10,680	6,020	-1,780	-1,720	-4,750	

数据和咨询来源: wind, 华融融达期货

免责声明: 本分析报告由华融融达期货股份有限公司提供, 仅作为所服务的特定企业与机构一般用途而准备, 未经许可任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、发布及分发本报告的全部或部分内容给其它任何人士。如引用发布, 须注明出处: 华融融达期货股份有限公司, 且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。本报告引用的信息和数据均来自于公开资料及其它合法渠道, 力求报告内容、引用资料和数据客观公正。尽可能保证可靠、准确和完整, 但并不保证报告所述信息的准确性和完整性, 本报告所提供的信息仅供参考, 不作为投资决策的依据, 客户应自主做出期货交易决策, 独立承担期货交易后果