

宏观大类资产日报:2023-03-30

一、宏观要点关注

- 据知情人士透露，美国联邦存款保险公司（FDIC）正考虑将高于正常水平的一部分负担转移给美国最大的几家银行，政客们敦促FDIC为小银行豁免这一成本。最近几家银行倒闭给FDIC造成了近230亿美元的损失。
- 美联储巴尔：我们在监管方面本可以做得更好；很难知道美联储是否有工具来防止硅谷银行的崩溃；美联储存在重大监管失误。
- 据国务院国资委，今年前两个月，中央企业累计完成投资（不含房地产）超3500亿元，同比增长5.6%。2023年中央企业在建、拟建重点固定资产投资项目900余项，1至2月份完成投资超1500亿元。
- 央行3月29日开展2000亿元7天期逆回购操作，中标利率2.0%。Wind数据显示，当日670亿元逆回购到期，因此单日净投放1330亿元。

二、全球大类资产表现一览表

大类资产	指标	收盘价	日涨跌	周涨跌	月涨跌	年度涨跌
大宗商品	NYMEX原油	72.81	-0.53%	5.13%	-5.50%	-9.28%
	LME铜	8980.50	0.03%	0.66%	0.22%	7.27%
	LME铝	2383.00	-0.25%	1.97%	0.42%	0.21%
	COMEX白银	23.47	0.21%	0.56%	11.39%	-2.37%
	COMEX黄金	1966.20	-0.37%	-0.89%	7.05%	7.67%
	SHFE螺纹钢	4151.00	0.73%	1.62%	-0.46%	1.57%
	美豆	1475.50	0.53%	3.31%	-0.24%	-3.18%
	美棉	82.73	0.25%	8.09%	-1.55%	-0.77%
	原糖	21.27	-0.19%	2.16%	5.98%	6.14%
	南华商品指数	2332.41	0.43%	0.74%	-2.19%	-2.03%
	南华工业品指数	3815.42	0.37%	0.88%	-2.81%	-1.94%
	南华农产品指数	1060.25	-0.06%	-0.29%	-6.18%	-5.55%
	南华金属指数	6399.43	0.22%	0.89%	-1.47%	-1.81%
	南华能化指数	1854.63	0.32%	0.77%	-3.88%	-2.19%
南华贵金属指数	725.39	0.47%	-0.43%	6.33%	2.13%	
股票	上证指数	3240.06	-0.16%	-0.78%	-1.21%	4.88%
	深证成指	11579.91	0.13%	-0.47%	-1.73%	5.12%
	沪深300	4006.14	0.17%	-0.52%	-1.56%	3.47%
	上证50	2636.22	-0.10%	-0.64%	-3.69%	0.04%
	中证500	6260.55	-0.31%	-0.79%	-1.53%	6.75%
	恒生指数	20192.40	2.06%	1.39%	2.05%	2.08%
	道琼斯工业指数	32717.60	1.00%	1.49%	0.19%	-1.30%
	纳斯达克指数	11926.24	1.79%	0.87%	4.11%	13.95%
	标普500	4058.00	1.41%	1.42%	2.08%	5.10%
	德国DAX	15328.78	1.23%	2.48%	-0.24%	10.09%
日经225	27870.00	2.11%	2.54%	1.62%	8.15%	
债券	中国国债:10年	2.86	0.04%	0.18%	1.81%	-1.67%
	中国国债:2年	2.41	-0.50%	-0.25%	3.03%	-3.36%
	美国国债:10年	3.57	-0.56%	-5.32%	14.29%	-19.33%
	美国国债:2年	4.08	-1.47%	-7.84%	19.85%	-42.40%
	中债长短端利差	0.45	2.92%	2.49%	-4.79%	7.50%
	美债长短端利差	-0.51	-7.84%	-25.49%	58.82%	-203.92%
	中美利差	-0.71	-2.94%	-27.33%	64.20%	-89.98%
	德国国债:10年	2.30	0.87%	-1.30%	20.00%	-39.13%
外汇与货币	美元指数	102.65	0.23%	-0.66%	-2.44%	-1.03%
	美元兑离岸人民币	6.88	0.03%	0.58%	-1.08%	-1.26%
	欧元兑美元	1.09	0.31%	0.89%	2.00%	1.67%
	SHIBOR隔夜	0.90	24.42%	72.92%	79.80%	-92.51%
	SHIBOR1周	2.16	-5.98%	-10.20%	-7.60%	-94.79%

美联储加息概率（当前利率区间：475-500）

MEETING PROBABILITIES												
MEETING DATE	225-250	250-275	275-300	300-325	325-350	350-375	375-400	400-425	425-450	450-475	475-500	500-525
5/3/2023						0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	60.1%	39.9%
6/14/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	1.0%	59.7%	39.3%
7/26/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.6%	35.2%	47.8%	16.4%
9/20/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.4%	22.4%	43.2%	28.0%	6.1%
11/1/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.2%	11.6%	33.0%	35.4%	16.8%	3.0%
12/13/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.1%	6.7%	23.8%	34.4%	24.8%	8.9%	1.3%
1/31/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.1%	4.1%	17.0%	30.1%	28.6%	15.3%	4.3%	0.5%
3/20/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2.9%	13.1%	26.2%	29.1%	19.3%	7.6%	1.7%	0.2%
5/1/2024	0.0%	0.0%	0.0%	2.8%	12.9%	26.0%	29.0%	19.5%	7.8%	1.8%	0.2%	0.0%
6/19/2024	0.0%	0.0%	1.1%	6.8%	18.0%	27.2%	25.3%	14.9%	5.4%	1.1%	0.1%	0.0%
7/31/2024	0.0%	0.8%	5.3%	15.2%	24.8%	25.8%	17.5%	7.9%	2.2%	0.4%	0.0%	0.0%
9/25/2024	0.8%	4.9%	14.2%	23.9%	25.7%	18.4%	8.8%	2.8%	0.6%	0.1%	0.0%	0.0%

数据和资讯来源:Wind、CME、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