

2023年03月30日

欧美银行业风险担忧有所缓解，全球风险偏好升温

——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：欧美银行业风险担忧有所缓解，全球风险偏好升温

1.宏观重要消息及事件：

周三，美联储负责监管的副主席巴尔在众议院委员会做证词陈述时表示，美联储在这次银行危机中存在重大监管失误。

继向第一共和银行注资后或又被抓壮丁，据悉FDIC考虑让华尔街大行分担更多近期银行业风波造成的230亿美元保险基金损失。

欧洲央行内部“鹰声不断”。欧洲央行首席经济学家连恩表示，在基线情景下，欧洲央行需要进一步加息。欧洲央行管委卡兹米尔也称，应该继续加息，但可能会以较慢的速度进行。

国务院总理李强29日会见IMF总裁格奥尔基耶娃。李强表示，今年以来中国经济呈现企稳回升态势。中国经济基础厚实，发展前景广阔，未来可期，将坚定不移扩大对外开放，稳妥防范化解风险。我们有信心、有能力实现全年发展目标任务。

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	78.28	78.42	-0.18%
WTI 原油	72.95	73.84	-1.21%
COMEX 黄金	1986.7	1975.3	0.58%
COMEX 白银	23.535	23.475	0.26%
LME 铜	8980.5	8957	0.26%
LME 铝	2383	2382.5	0.02%
LME 锌	2961.5	2917	1.53%
螺纹钢	4151	4136	0.36%
铁矿	890.5	882	0.96%
全球主要股票市场			
道琼斯工业平均指数	32717.60	32394.25	1.00%
恒生指数	20192.40	19784.65	2.06%
日经 225 指数	27883.78	27518.25	1.33%
上证指数	3240.0568	3245.376	-0.16%
法国 CAC40 指数	7186.99	7088.34	1.39%
英国富时 100 指数	7564.27	7484.25	1.07%
德国法兰克福指数	15328.78	15142.02	1.23%

数据来源：文华财经，东海期货研究所整理。

3. 风国内流动性概况：

	上一日收盘	前值	变动 (BP)
SHIBORO/N	0.90	1.12	-22
SHIBOR1W	2.16	2.03	13
SHIBOR3M	2.46	2.46	-1
R007	3.45	3.35	10
DR007	2.14	1.99	14

数据来源：Wind，东海期货研究所整理。

4. 重要财经日历：

- 1、 17:00 欧元区3月消费者信心指数终值
- 2、 17:00 欧元区3月工业及经济景气指数
- 3、 20:00 德国3月CPI月率初值
- 4、 20:30 美国第四季度实际GDP年化季率终值
- 5、 20:30 美国第四季度核心PCE物价指数年化季率终值
- 6、 次日01:00 美联储卡什卡利发表讲话

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商或者其他公开信息，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