

# 宏观大类资产日报:2023-04-06

## 一、宏观要点关注

- 1、美联储梅斯特表示，现在判断美联储是否会在5月份加息还为时过早；预计利率将略有提高，然后保持不变；银行业的紧张局势增加了利率走势的不确定性；企业正在为经济放缓做准备；现在不清楚银行动荡影响的持续时间和程度。
- 2、美国3月ADP就业人数增14.5万人，预期增20万人，前值由增24.2万人修正为增26.1万人。
- 3、美国2月贸易帐逆差705亿美元，预期逆差690亿美元，前值由逆差683亿美元修正为逆差687亿美元。
- 4、美国3月Markit服务业PMI终值 52.6，预期53.8，初值53.8；综合PMI终值52.3，预期53.3，初值53.3。

## 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	80.35	-0.45%	6.18%	6.18%	0.11%
	LME铜	8779.00	0.32%	-2.38%	-2.38%	4.86%
	LME铝	2340.50	-1.27%	-3.00%	-3.00%	-1.58%
	COMEX白银	25.09	-0.04%	3.87%	3.87%	4.37%
	COMEX黄金	2037.10	-0.05%	2.56%	2.56%	11.55%
	SHFE螺纹钢	休	休	-3.76%	-3.76%	-1.69%
	美豆	1509.25	-0.54%	0.25%	0.25%	-0.97%
	美棉	81.08	0.04%	-2.05%	-2.05%	-2.75%
	原糖	22.94	2.09%	3.10%	3.10%	14.47%
	南华商品指数	休	休	0.53%	0.53%	-0.89%
	南华工业品指数	休	休	0.21%	0.21%	-1.37%
	南华农产品指数	休	休	0.71%	0.71%	-4.62%
	南华金属指数	休	休	-1.44%	-1.44%	-3.22%
	南华能化指数	休	休	1.44%	1.44%	-0.15%
南华贵金属指数	休	休	0.01%	0.01%	3.69%	
股票	上证指数	休	休	1.21%	1.21%	7.23%
	深证成指	休	休	1.13%	1.13%	7.66%
	沪深300	休	休	1.29%	1.29%	5.98%
	上证50	休	休	0.53%	0.53%	1.54%
	中证500	休	休	1.09%	1.09%	9.28%
	恒生指数	休	休	-0.62%	-0.62%	2.49%
	道琼斯工业指数	33482.72	0.24%	0.63%	0.63%	1.01%
	纳斯达克指数	11996.86	-1.07%	-1.84%	-1.84%	14.62%
	标普500	4114.50	-0.35%	-0.56%	-0.56%	6.57%
	德国DAX	15520.17	-0.53%	-0.70%	-0.70%	11.47%
日经225	27745.00	-1.46%	-1.86%	-1.86%	7.66%	
债券	中国国债:10年	2.86	0.09%	-0.13%	0.72%	-2.19%
	中国国债:2年	休	休	0.67%	1.49%	-2.30%
	美国国债:10年	3.30	1.52%	7.58%	19.09%	-12.73%
	美国国债:2年	3.79	1.32%	8.18%	29.29%	-33.77%
	中债长端利差	0.46	0.54%	-4.24%	-3.23%	-1.61%
	美债长端利差	-0.49	0.00%	12.24%	97.96%	-175.51%
	中美利差	-0.44	10.79%	57.63%	138.44%	-81.21%
	德国国债:10年	2.29	0.44%	1.31%	17.47%	-38.86%
外汇与货币	美元指数	101.90	0.31%	-0.68%	-0.68%	-1.54%
	美元兑离岸人民币	休	休	-0.03%	-0.03%	-1.36%
	欧元兑美元	休	休	0.87%	0.87%	2.66%
	SHIBOR隔夜	1.10	22.76%	-18.31%	49.41%	-93.88%
	SHIBOR1周	1.87	2.89%	15.35%	2.41%	-93.99%

## 美联储加息概率 (当前利率区间: 475-500)

MEETING PROBABILITIES														
MEETING DATE	175-200	200-225	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%	58.8%	41.2%
6/14/2023			0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	6.9%	56.7%	36.3%
7/26/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	5.3%	45.2%	41.0%	8.4%
9/20/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	4.7%	40.4%	41.5%	12.3%	1.0%
11/1/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	3.3%	30.0%	41.2%	20.9%	4.3%	0.3%
12/13/2023	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2.9%	26.9%	39.9%	23.2%	6.2%	0.8%	0.0%
1/31/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2.5%	23.3%	37.9%	25.8%	8.8%	1.6%	0.1%	0.0%
3/20/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	2.2%	21.2%	36.5%	27.0%	10.5%	2.3%	0.3%	0.0%	0.0%
5/1/2024	0.0%	0.0%	0.0%	0.4%	5.3%	23.7%	34.9%	24.3%	9.2%	2.0%	0.2%	0.0%	0.0%	0.0%
6/19/2024	0.0%	0.0%	0.2%	2.6%	13.4%	28.6%	30.2%	17.6%	6.0%	1.2%	0.1%	0.0%	0.0%	0.0%
7/31/2024	0.0%	0.1%	2.1%	11.2%	25.5%	29.9%	20.2%	8.4%	2.2%	0.4%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
9/25/2024	0.1%	2.0%	10.7%	24.8%	29.7%	20.7%	9.0%	2.5%	0.5%	0.1%	0.0%	0.0%	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人士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