

2023年04月27日

经济衰退担忧加深，美联储加息预期降温

——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：经济衰退担忧加深，美联储加息预期降温

1.宏观重要消息及事件：

第一共和银行市值跌破10亿美元，跌近40%。此前消息人士称，美国政府目前不愿对第一共和银行采取干预措施。第一共和银行评级恐遭FDIC下调，或致使其使用美联储的紧急贷款工具受限。

美国3月耐用品订单月率录得3.2%，创2022年12月以来新高，大幅超过预期的0.70%，前值从-1.00%下修为-1.2%。

美国众议院议长麦卡锡修改债务上限提案以赢得投票支持。目前众议院通过共和党支持的债务上限法案，但料将无法在参议院通过。据标普全球市场情报，美国五年期信贷违约掉期（CDS）涨至62个基点，为自2011年以来最高水平。

中指研究院统计数据 displays，目前已有超40城调整首套房贷利率下限至4%以下，进入“3时代”。但多家沪上银行表示，目前所加基点都没有变化。至于未来基点调整暂时还没有相关安排。

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	77.77	80.6	-3.51%
WTI 原油	74.42	77.26	-3.68%
COMEX 黄金	1996.4	2007.9	-0.57%
COMEX 白银	24.835	25.06	-0.90%
LME 铜	8529	8528.5	0.01%
LME 铝	2331	2332	-0.04%
LME 锌	2648.5	2601	1.83%
螺纹	3719	3685	0.92%
铁矿	716.5	711	0.77%
全球主要股票市场			
道琼斯工业平均指数	33301.87	33530.83	-0.68%
恒生指数	19757.27	19617.88	0.71%
日经 225 指数	28416.47	28620.07	-0.71%
上证指数	3264.1006	3264.8717	-0.02%
法国 CAC40 指数	7466.66	7531.61	-0.86%
英国富时 100 指数	7852.64	7891.13	-0.49%

德国法兰克福指数	15795.73	15872.13	-0.48%
----------	----------	----------	--------

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)
SHIBORO/N	1.22	1.68	-47
SHIBOR1W	2.06	2.02	4
SHIBOR3M	2.43	2.43	0
R007	2.40	2.44	-4
DR007	2.06	2.04	1

数据来源：Wind，东海期货研究所整理。

4. 重要财经日历：

- 17:00 欧元区4月工业及经济景气指数
- 17:00 欧元区4月消费者信心指数终值
- 20:30 美国至4月22日当周初请失业金人数
- 20:30 美国第一季度实际GDP年化季率初值
- 20:30 美国第一季度实际个人消费支出季率初值
- 20:30 美国第一季度核心PCE物价指数年化季率初值

重要声明

本报告由东海期货有限责任公司研究所团队完成，报告中信息均源于公开可获得资料。东海期货力求报告内容的客观、公正，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。报告中的观点、结论和建议等全部内容只提供给客户做参考之用，并不构成对客户的投资建议，也未考虑个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要，客户不应单纯依靠本报告而取代个人的独立判断。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责任，交易者需自行承担风险。本报告版权仅为东海期货有限责任公司研究所所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制发布，如引用、转载、刊发，须注明出处为东海期货有限责任公司。

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