

2023年05月26日

美国债务上限接近达成协议，提振市场情绪

——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：美国债务上限接近达成协议，提振市场情绪

1.宏观重要消息及事件：

据知情人士，美国债务上限精简版协议已经初步成形，双方在可自由支配开支提议方面的差值小于700亿美元，而共和党愿在国防开支上让步。麦卡锡表示，周四没能达成协议，周末将加班加点、财政部已在准备债务上限突破情况下的应急预案。

美国至5月20日当周初请失业金人数录得22.9万人，远低于预期，创2023年4月22日当周以来新低；同时一季度GDP年率从1.1%上修至1.3%。数据公布后，互换市场完全定价美联储到七月会议前加息25个基点，6月加息25个基点的可能性已经超过50%，到年底利率将较隐含峰值降息约37BP，至4.95%。

欧洲央行管委诺特称，未来两次加息应该每次加25个基点。欧洲央行管委维勒鲁瓦认为，欧洲央行利率应在接下来的三次会议中达到峰值。

德国第一季度GDP终值环比萎缩0.3%，为连续第二个季度出现环比萎缩，意味着该国经济陷入技术性衰退。另外，德国6月GfK消费者信心指数-24.2，为2022年4月以来新高，预期-24，前值-25.7。

据俄罗斯媒体报道，俄罗斯副总理诺瓦克认为6月4日欧佩克+会议不会有新举措，但如有必要，欧佩克+将共同达成共识并采取措施。他预计布伦特原油价格将在年底前超过每桶80美元。

商务部新闻发言人束珏婷介绍，25日至26日，中国商务部部长王文涛将参加APEC贸易部长会，期间将与美国商务部部长雷蒙多和贸易代表戴琪会谈，就中美经贸关系和双方共同关注的问题和美方交流。

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	76.23	78.24	-2.57%
WTI 原油	71.88	74.08	-2.97%
COMEX 黄金	1944.4	1959.3	-0.76%
COMEX 白银	22.945	23.17	-0.97%
LME 铜	7990	7891	1.25%
LME 铝	2214	2206	0.36%
LME 锌	2257.5	2295	-1.63%
螺纹	3432	3466	-0.98%
铁矿	681	682.5	-0.22%

全球主要股票市场			
道琼斯工业平均指数	32764.65	32799.92	-0.11%
恒生指数	18746.92	19115.93	-1.93%
日经 225 指数	30801.13	30682.68	0.39%
上证指数	3201.2605	3204.7494	-0.11%
法国 CAC40 指数	7229.27	7253.46	-0.33%
英国富时 100 指数	7570.87	7627.1	-0.74%
德国法兰克福指数	15793.80	15842.13	-0.31%

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	1.58	1.27	31
SHIBOR1W	1.91	1.76	15
SHIBOR3M	2.24	2.25	-1
R007	2.16	1.85	30
DR007	1.92	1.75	17

数据来源：Wind，东海期货研究所整理。

4. 重要财经日历：

- 1、 20:30 美国4月核心PCE物价指数年率
- 2、 20:30 美国4月核心PCE物价指数月率
- 3、 20:30 美国4月个人支出月率
- 4、 20:30 美国4月耐用品订单月率
- 5、 22:00 美国5月一年期通胀率预期
- 6、 22:00 美国5月密歇根大学消费者信心指数终值

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