

2023年05月31日

市场对美国债务上限协议广泛乐观，避险情绪降温

——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：市场对美国债务上限协议广泛乐观，避险情绪降温

1.宏观重要消息及事件：

债务上限法案-众议院规则委员会一名关键共和党成员将支持法案，投票或得到推进、部分议员提交了修正案、财政部现金回升至545亿美元。美国共和党众议员麦克亨利和民主党众议员Boyle都表示称，将有足够多的票数支持债务上限协议。早些时候，一些极右翼的共和党议员表示，他们可能会反对提高债务上限。

里士满联储主席巴尔金表示，通胀将比许多人认为的更为顽固，利率处于限制性区间，但需要到达何处存在不确定性。一旦通胀消退，美国经济可能会支持利率处于“中性、正常水平”，而不是推至接近0的水平。

美国3月S&P/CS20座大城市房价指数年率录得-1.1%，为2012年4月以来最大降幅，结束了自2012年5月以来增长趋势。美国5月达拉斯联储商业活动指数录得-29.1，远低于预期的-18，为2020年5月以来新低。

伊朗和国际原子能机构就核计划的两个争议达成解决方案。另据Axios报道，拜登顾问本月早些时候与阿曼官员就伊朗核项目问题可能与伊朗进行外交接触进行了会谈。欧佩克秘书长告诉伊朗石油部网站SHANA，欧佩克将欢迎伊朗在制裁取消后全面重返石油市场。

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	73.87	77.1	-4.19%
WTI 原油	69.54	73.04	-4.79%
COMEX 黄金	1976.9	1946.1	1.58%
COMEX 白银	23.28	23.445	-0.70%
LME 铜	8115	8139	-0.29%
LME 铝	2228	2243	-0.67%
LME 锌	2290	2338	-2.05%
螺纹	3460	3511	-1.45%
铁矿	707.5	719	-1.60%
全球主要股票市场			
道琼斯工业平均指数	33042.78	33093.34	-0.15%
恒生指数	18595.78	18551.11	0.24%
日经 225 指数	31328.16	31233.54	0.30%
上证指数	3224.2133	3221.4484	0.09%

法国 CAC40 指数	7209.75	7303.81	-1.29%
英国富时 100 指数	7522.07	7627.2	-1.38%
德国法兰克福指数	15908.91	15952.73	-0.27%

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)
SHIBOR0/N	1.30	1.37	-7
SHIBOR1W	1.99	1.94	6
SHIBOR3M	2.22	2.23	-1
R007	2.18	2.14	5
DR007	2.07	1.96	11

数据来源：Wind，东海期货研究所整理。

4. 重要财经日历：

- 1、 09:30 中国5月官方制造业PMI
- 2、 14:45 法国5月CPI月率
- 3、 14:45 法国第一季度GDP年率终值
- 4、 15:55 德国5月季调后失业人数及失业率
- 5、 16:00 欧洲央行公布金融稳定评估报告
- 6、 20:00 德国5月CPI月率初值
- 7、 次日02:00 美联储公布经济状况褐皮书

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