

2023年06月02日

美联储6月或暂停加息，美元指数下跌

——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：美联储6月或暂停加息，美元指数下跌

1.宏观重要消息及事件：

费城联储主席哈克认为，至少应该跳过6月份的加息，然后密切关注数据，以评估是否需要进一步的政策收紧，并且需要在整个2023年维持紧缩水平。圣路易斯联储主席布拉德称，仍需要对通胀降温的前景保持警惕。截至发稿，CME“美联储观察”显示，美联储6月按兵不动的概率为81.9%。

有“小非农”之称的美国5月ADP就业人数增加27.8万人，超越预期的17万人，较前值的29.6万人有所回落。上周初请失业金人数录得23.2万人，为四周以来最高，略低于市场预期的23.5万人，较前值22.9万人小幅上升。美国5月ISM制造业指数录得46.9，较4月回落，且不及预期，已连续七个月萎缩，持续萎缩时间创下2009年以来最长。

美国众议院两党议员以314票赞成、117票反对的投票结果共同通过了债务上限法案，法案接下来将递交给参议院。美国参议院多数党领袖舒默称，他乐观地认为参议院将会通过债务上限协议。当前距离财政部预估的潜在违约日（6月5日）仅剩4天。

据欧佩克+消息人士称，欧佩克及其盟友不太可能在6月4日的会议上宣布进一步减产。另外，调查显示，欧佩克的原油产量在5月份下降了50万桶/日，降至2826万桶/日。

欧洲央行会议纪要显示，几乎所有委员支持加息25个基点，一些委员最初表示倾向于将欧洲央行的关键利率提高50个基点，银行面临的短期利率风险似乎得到了控制。

据财新，5月财新中国制造业采购经理指数（PMI）录得50.9，较4月回升1.4个百分点，时隔两个月重回扩张区间。

美财政部官员称美正考虑制定新规，限制美投资和技术流向中国先进半导体、人工智能和量子计算等领域公司，外交部回应：这种行为损人不利己，中方将密切关注。

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	74.32	72.13	3.04%
WTI 原油	70.15	67.79	3.48%
COMEX 黄金	1995.5	1981	0.73%
COMEX 白银	23.985	23.615	1.57%
LME 铜	8231.5	8110	1.50%
LME 铝	2270	2247	1.02%
LME 锌	2277	2252	1.11%
螺纹	3546	3463	2.40%

铁矿	743	711	4.50%
全球主要股票市场			
道琼斯工业平均指数	33061.57	32908.27	0.47%
恒生指数	18216.91	18234.27	-0.10%
日经 225 指数	31148.01	30887.88	0.84%
上证指数	3204.6345	3204.5644	0.00%
法国 CAC40 指数	7137.43	7098.7	0.55%
英国富时 100 指数	7490.27	7446.14	0.59%
德国法兰克福指数	15853.66	15664.02	1.21%

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	1.74	1.72	2
SHIBOR1W	1.85	2.06	-21
SHIBOR3M	2.21	2.22	-1
R007	1.93	2.09	-16
DR007	1.83	2.08	-25

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5月失业率
- 2、 20:30 美国5月季调后非农就业人口

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