

F
U
T
U
R
E
S
R
E
S
E
A
R
C
H
R
E
P
O
R
T

期货研究



瑞达期货
RUIDA FUTURES



金尝发

宏观市场每日全景分析报告

2021年12月2日 星期四

宏观经济

	11月实际值	前值
GDP 同比 (%)	-	4.9
官方制造业 PMI (%)	50.1	49.2
工业增加值同比 (%)	-	3.5
固定资产投资同比 (%)	-	6.1
社会消费品零售同比 (%)	-	4.9
出口同比 (%，按美元计)	-	27.1
进口同比 (%，按美元计)	-	20.6
CPI 同比 (%)	-	1.5
PPI 同比 (%)	-	13.5
新增贷款 (万亿)	-	0.83
新增社会融资规模 (万亿)	-	1.59
M1 同比 (%)	-	2.8
M2 同比 (%)	-	8.7

- 1、证监会回应“有境外媒体报道称中国证监会将禁止协议控制架构(VIE)企业在境外上市”表示，注意到了相关媒体的报道，这一消息不属实。
- 2、新能源车企11月新车交付集体发力，小鹏汽车坐稳“一哥”位置，哪吒汽车挺进“万辆俱乐部”。数据显示，小鹏汽车11月交付15613辆汽车，同比增长270%，再创交付纪录。理想汽车交付量达13485辆，同比增长190.2%，同样创单月交付纪录。蔚来交付量为10878辆，同比增长105.6%。哪吒汽车交付量首度破万，达到10013台，同比增长372%。另外，零跑11月总订单达16310辆，交付量5628辆，均创单月新高；威马汽车交付5027辆，并再获1.52亿美元D2轮融资；极氪汽车交付2012辆。
- 3、中国11月财新制造业PMI为49.9，较10月下降0.7个百分点，继8月之后再次位于荣枯线以下，反映制造业修复进程放缓。财新智库高级经济学家王喆表示，11月制造业景气度基本维持平稳，经济下行压力增加和通胀压力缓解是突出特征。

货币市场

	利率水平	较前一日变动 (bp)
隔夜 Shibor	2.0170	-15.60
7天 Shibor	2.1210	-17.60
14天 Shibor	2.1150	-46.10
1个月 Shibor	2.3570	0.10

周三(12月1日)央行公开市场开展100亿元7天期逆回购,当日有1000亿元逆回购到期,净回笼900亿元。隔夜品种下行15.60bp报2.0170%。

外汇市场

美元指数	美元兑人民币	欧元兑美元
96.0407	6.3705	1.1321
0.15% 6.69%,Ytd	0.01% -2.40%,Ytd	-0.15% -7.41%,Ytd



周三(12月1日)美元指数涨0.15%报96.0407,本周跌0.03%。欧元兑美元跌0.15%报1.1321,英镑兑美元跌0.19%报1.3276,澳元兑美元跌0.31%报0.7106,美元兑日元跌0.35%报112.7700,离岸人民币兑美元跌84个基点报6.3732。在岸人民币兑美元16:30收报6.3705,较前一交易日下跌4个基点,周涨208个基点。人民币兑美元中间价调升101个基点,报6.3693。

海外财经新闻

- 1、美联储主席鲍威尔表示，所看到的通货膨胀显然仍与新冠疫情有关，但通胀的蔓延范围变广了；通胀持续的风险已经上升，不能再用“暂时性”这个词了；政策将继续适应通胀的变化；价格稳定和就业形势紧张；将利用各种手段确保高通胀不会根深蒂固。在下次会议上讨论加快缩债是合适的。
- 2、美联储褐皮书显示，美国经济温和扩张，但结果在一定程度上喜忧参半。零售销售略微走软，餐厅和销售在 9 月份反弹，制造业在三季度温和增长，大部分正在招聘员工的公司称收入大幅增长。劳动力需求稳健，平均物价涨幅温和。前景主要偏正面，但受访对象坦言，通胀、供应链紊乱、以及强制性疫苗接种要求对劳动力市场的影响都造成不确定性。
- 3、欧盟委员会主席冯德莱恩表示，欧盟应该讨论是否需要强制性疫苗接种，以帮助应对新冠肺炎病例的持续激增以及新奥密克戎变异毒株的威胁。
- 4、美国 11 月 ISM 制造业 PMI 从前一个月的 60.8 升至 61.1，符合预期。其中，制造业生产指标升至七个月高位，新订单指标加速，就业指标也升至七个月高位。
- 5、欧元区 11 月制造业 PMI 终值从 10 月的 58.3 小幅升至 58.4，低于最初预估的 58.6，但仍远高于荣枯分水岭 50。但供应链瓶颈恶化，令产出受到限制，并以逾 20 年来最快速度推高原材料成本。

预览已结束，完整报告链接和二维码如下：

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_30412

