

宏观与金融期货日报

2020/4/2

日报

中粮期货研究院

宏观与金融期货组

柳瑾

电话：010-59137357

投资咨询号

Z0012424

徐乾程

电话：010-59137331

宏观及金融期货要点

- 国家最高领导人在浙江考察时强调,要做好统筹推进新冠肺炎疫情防控和经济社会复工发展工作。
- 中国3月财新制造业PMI回升至50.1 景气度基本回稳。
- 外商独资公募基金正式破冰。
- 亚洲多国PMI萎缩加剧 欧元区数据创92个月新低。
- 美国3月ISM制造业创去年12月新低 新订单和就业创2009年新低。
- 俄罗斯：不打算在原油供应过度情况下增加产量。
- 美国上周原油库存增幅创2016年10月以来最大值 美油盘中破20美元。
- 德意两国延长封国时间。

免责声明

本报告信息全部来源于公开性资料,本报告观点可能会与相应公司的投资发展策略或相关商品价格趋势产生分歧,本报告不对所涉及信息的准确性和完整性作任何保证。因此本报告仅可视为经济及金融信息参考但并不构成任何投资建议且不为任何投资行为负责。

热点事件

市场概述

上证指数收盘跌 0.57% 报 2734.52 点; 深证成指跌 0.1% 报 9951.84 点; 创业板指跌 0.38% 报 1864.8 点; 两市成交额不足 6000 亿元。北向资金净流入逾 42 亿元, 海康威视获净买入 6.32 亿元, 五粮液、万科 A 分别获净买入逾 4 亿元。

恒生指数收跌 2.19% 险守 23000 点, 报 23085.79 点, 国企指数跌 1.98%, 红筹指数跌 2.15%。全日大市成交 1312 亿港元, 前一交易日为 1133 亿港元。中国台湾加权指数收盘跌 0.46%, 报 9663.63 点。

美国三大股指跌幅均超 4.4%, 道指收跌近千点。波音大跌 12.4%, 美国运通跌超 9%, 领跌道指。沃尔玛涨 0.56%, 为道指成分股中唯一上涨个股。苹果、谷歌均跌超 5%, 特斯拉跌超 8%。截至收盘, 道指跌 4.44% 报 20943.51 点, 标普 500 跌 4.41% 报 2470.5 点, 纳指跌 4.41% 报 7360.58 点。美国冠状病毒确诊超 20 万例, 美国总统特朗普警告称未来两周将“非常艰难”。

国家最高领导人在浙江考察时强调, 要做好统筹推进新冠肺炎疫情防控和经济社会发展工作

精准落实疫情防控和复工复产各项举措, 奋力实现今年经济社会发展目标任务; 要把严防境外疫情输入作为当前乃至较长一段时间疫情防控的重中之重, 增强防控措施的针对性和实效性, 筑起应对境外疫情输入风险的坚固防线, 不能出现任何漏洞。要有力有序推动复工复产提速扩面; 加强对国际经济形势研判分析, 及时制定有针对性的政策举措, 保持国际供应链畅通; 加快 5G 网络、数据中心等新型基础设施建设, 抓紧布局数字经济、生命健康、新材料等战略性新兴产业、未来产业。

中国 3 月财新制造业 PMI 回升至 50.1 景气度基本回稳

3 月财新中国制造业 PMI 为 50.1, 较 2 月的历史低点回升 9.8 个百分点。这一走势与官方制造业 PMI 一致, 此前国家统计局公布, 3 月制造业 PMI 录得 52, 环比回升 16.3 个百分点。“3 月制造业承受双重压力, 复工复产尚不充分, 叠加外需恶化、国内消费需求尚未大面积启动, 因而造成生产扩

免责声明

本报告信息全部来源于公开性资料, 本报告观点可能会与相应公司的投资发展策略或相关商品价格趋势产生分歧, 本报告不对所涉及信息的准确性和完整性作任何保证。因此本报告仅可视为经济及金融信息参考但并不构成任何投资建议且不为任何投资行为负责。

张仍有限，没有看到明显的生产回补。”

外商独资公募基金正式破冰

证监会官网显示，贝莱德及路博迈两家外资资管机构正式递交公募基金设立申请。贝莱德全球资管规模排名第一；路博迈亦是国际老牌资产管理公司，其中一位创始人被称为“美国共同基金之父”。

亚洲多国 PMI 萎缩加剧 欧元区数据创 92 个月新低

全球供应链的中断继续波及亚洲和欧洲的制造业，在欧洲，除了食品制造业和制药业，其他行业出现“前所未有的低迷”。

美国 3 月 ISM 制造业创去年 12 月新低 新订单和就业创 2009 年新低

美国 3 月 ISM 制造业指数 49.1，创去年 12 月以来新低，预期 44.5，前值 50.1。受新冠肺炎疫情影响，其中订单和就业分项指数创 2009 年来最低。

俄罗斯：不打算在原油供应过度情况下增加产量

沙特方面未有让步的迹象。行业消息称，沙特阿美石油供应量升至 1200 万桶/日以上方。

美国上周原油库存增幅创 2016 年 10 月来最大 美油盘中破 20 美元

上周 EIA 原油库存增幅大超预期，达到 1383.3 万桶，创下 2016 年 10 月来最大。美国汽油需求创历史最大单周降幅。数据公布后，WTI 原油期货下挫 0.25 美元，使得日内整体跌幅扩大至超过 1.2%，盘中一度跌破 20 美元。

德意两国延长封国时间

意大利政府已决定将应对新冠病毒的封锁措施延长到 4 月 13 日。意大利经济部长：将通过的刺激方案将规模比 3 月 1 日大得多，足以在整个疫情期间为经济和家庭提供支撑；当前使用欧洲稳定机制纾困基金不是考虑的选项之一。德国总理默克尔：德国将延长全国封锁措施至 4 月 19 日，将在复活节后的周二重新评估，现在结束社交疏离措施为时过早，必须禁止公民的个人旅游行程，德国各州将加入限制措施的行动中。

免责声明

本报告信息全部来源于公开性资料，本报告观点可能会与相应公司的投资发展策略或相关商品价格趋势产生分歧，本报告不对所涉及信息的准确性和完整性作任何保证。因此本报告仅可视为经济及金融信息参考但并不构成任何投资建议且不为任何投资行为负责。

【法律声明】

中粮期货有限公司（以下简称“本公司”）具有中国证监会核准的期货投资咨询业务资格（证监会批文号：证监许可[2011]1453）。

报告所引用信息和数据均来源于公开资料和合法渠道，中粮期货分析师力求报告内容和引用资料和数据客观与公正，但不对所引用资料和数据本身的真实性、准确性和完整性做出保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。报告中的任何观点与建议仅代表报告当日对市场的判断，仅供阅读者参考。阅读者根据本报告做出的任何投资决策及其所引致的任何后果，概与本公司及分析师无关。

本公司的销售人员、交易人员以及其他专业人士可能会依据不同假设和标准、采用不同的分析方法而口头或书面发表与本报告意见及建议不一致的市场评论和/或交易观点。本公司没有将此意见及建议向报告所有接收者进行更新的义务。

本报告版权归本公司所有，为非公开资料，仅供本公司咨询业务的客户使用。未经本公司书面授权，任何人不得以任何形式传送、发布、复制本报告。本公司保留对任何侵权行为和有悖报告原意的引用行为进行追究的权利。未经授权的转载，本公司不承担任何转载责任。

免责声明

本报告信息全部来源于公开性资料，本报告观点可能会与相应公司的投资发展策略或相关商品价格趋势产生分歧，本报告不对所涉及信息的准确性和完整性作任何保证。因此本报告仅可视为经济及金融信息参考但并不构成任何投资建议且不为任何投资行为负责。