

每日金融市场 (20220609)

青岛中油贸易有限公司

Qingdao Resources Trading Co., Ltd.

本期主要内容:

- 一、市场综述
- 二、人民币对全球主要货币中间价
- 三、经济要闻和市场摘要

市场综述

美国 10 年期国债收益率上涨 5.9 个基点至 3.03%，而美元兑 G10 货币涨跌互现，美元指数升至 102.6。纳斯达克 100 指数和标准普尔 500 指数分别回撤 0.73% 和 1.08%。原油价格飙升至 122.0。市场预计欧洲央行将于周四结束量化宽松政策，为退出负利率铺平道路，并将政策重点转向应对失控的通胀水平。OECD 下调全球经济增长预测，称俄乌战争可能对世界经济造成持久影响。美国证监会主席打算采取措施修改美国股票交易规则，该规则旨在订单流 (payment-for-order flow) 付费。

中国国务院常务会议要求确保第二季度合理增长，稳定外贸和投资。中国今天将发布 5 月贸易数据，市场预测出口增长将反弹。美国财政部长耶伦表示，拜登政府正寻求措施重新调整对中国商品征收的关税。台湾 5 月出口额达 420.8 亿美元，为历年单月第二高。北京称新冠传播链已被有效切断。

今天人民币中间价是 6.6811。

人民币对主要货币汇率中间价

日期	美元	欧元	日元	港元	英镑	林吉特 malaysian ringgit	卢布	澳元	加元	新西兰 元	新加坡 元	瑞士法 郎
2022-06-09	668.11	716.08	4.9708	85.132	837.94	65.728	902.11	480.67	532.37	430.79	485.64	682.79
2022-06-08	666.34	712.89	5.0168	84.927	838.72	65.946	924.34	481.39	531.53	431.9	484.84	684.54
2022-06-07	666.49	712.28	5.0416	84.956	834.1	65.882	920.89	478.6	529.53	431.91	483.69	685.85
2022-06-06	666.91	715.61	5.1006	84.997	833.75	65.723	945.49	481.11	530.33	434.35	485.2	693.34
2022-06-02	670.95	714.83	5.1562	85.502	837.75	65.398	943.71	481.45	529.92	435.24	487.87	696.87
2022-06-01	666.51	715.31	5.1756	84.946	840.31	65.653	936.84	478.77	527.41	434.7	486.48	694.68
2022-05-31	666.07	717.47	5.2102	84.865	842.02	65.546	957.21	478.8	526.18	436.31	487.21	694.87
2022-05-30	670.48	719.45	5.2691	85.42	846.64	65.298	990.35	480.01	527.02	437.79	489.98	699.99
2022-05-27	673.87	723.32	5.3038	85.847	850.24	65.205	958.61	478.72	527.55	437.01	491.06	703.08
2022-05-26	667.66	713.89	5.2483	85.057	841.01	65.773	888.75	474.05	521.13	433.08	486	694.51

日期	兰特 South African Rand	韩元	迪拉姆 UAE Dirham	里亚尔 IranianRial	福林 Hungarian Forint	兹罗提 Polish zloty	丹麦克 朗	瑞典克 朗	挪威克 朗	里拉	比索	泰铢
2022-06-09	228.78	18801	54.964	56.136	5518.4	64.005	103.86	147.01	141.73	257.22	292.99	516.48
2022-06-08	230.82	18826	55.119	56.294	5447.9	64.17	104.33	146.99	141.98	252.68	293.97	516.68
2022-06-07	231.94	18832	55.101	56.27	5435.6	64.346	104.43	147.04	141.52	249.25	293.78	516.61
2022-06-06	232.78	18740	55.036	56.203	5476.1	64.069	103.93	146.33	141.32	247.25	292.83	514.91
2022-06-02	232.26	18591	54.731	55.891	5541.6	64.125	104.03	146.68	141.29	244.84	293.55	512.02
2022-06-01	234.45	18622	55.099	56.264	5548.4	64.02	103.99	146.5	140.57	246.03	294.86	514.47
2022-05-31	232.5	18568	55.131	56.304	5489.1	63.9	103.69	146.46	141.26	245.97	293.51	512
2022-05-30	232.65	18682	54.774	55.937	5477.1	63.529	103.39	146.57	141.29	243.78	292.09	508.58
2022-05-27	233.17	18707	54.487	55.651	5423.8	63.622	102.83	146.28	141.48	242.76	293.26	507.43
2022-05-26	235.35	18927	54.992	56.161	5495.4	64.398	104.2	147.55	143.19	244.77	296.64	512.52

国际金融市场

CNY 汇率中间价	今日	昨日	点数变化量
美元/人民币 (USDCNY)	6.6634	6.6649	-15
欧元/人民币 (EURCNY)	7.1289	7.1228	61
港元/人民币 (HKDCNY)	0.8493	0.8496	-2.9
英镑/人民币 (GBPCNY)	8.3872	8.3410	462

人民币市场主要利率 指标	今日	昨日	点数变化量
3 个月 Shibor	2.0030	2.0010	20.0000
7 天逆回购 7D Repo	1.6500	1.6800	-300.0000
3 个月央行央票收益率 PBOC Bill Yields 3M	1.6442	1.6414	28.0000
人民币 3 个月互换利率 IRS 3M	1.8400	1.8500	-100.0000

其他主要利率和价格 指标	现价	涨跌 (%)
美国 5 年国债基准利率 (US 5Y)	3.00	0.58
美国 10 年国债基准利率 (US 10Y)	2.99	0.74
美国 30 年国债基准利率 (US 30Y)	3.14	0.59
布伦特原油 (ICE Brent Crude)	120.75	0.15
国际金价 (Gold)	1,849.19	-0.13

全球主要证券指数	开市价	上日收市价	涨跌 (%)
美元指数 (NYF)	102.41	102.42	0.11
道琼斯工业指数 (Dow Jones)	32,788.03	32,915.78	-0.4
纳斯达克指数 (NASDAQ)	11,925.81	12,061.37	-1.14
标准普尔 500 (S&P500)	4,121.43	4,096.47	0.61
恒生指数 (Hang Seng)	21,577.48	21,653.90	-0.35

USD Libor (%)	今日	昨日	变化量
O/N	0.8191	0.8220	-0.0029
1M	1.1197	1.1199	-0.0002
3M	1.6260	1.6107	0.0153
6M	2.1093	2.1060	0.0033

HKD Hibor (%)	今日	昨日	变化量
O/N	0.0486	0.0519	-0.0033
1M	0.2395	0.2286	0.0109
3M	0.8999	0.8995	0.0004
6M	1.6812	1.6913	-0.0101

CNH Hibor (%)	今日	昨日	变化量
---------------	----	----	-----

O/N	1.8068	1.8330	-0.0262
1M	2.3665	2.3643	0.0022
3M	2.7050	2.7090	-0.0040
6M	2.9585	2.9620	-0.0035
CNY Shibor (%)			
	今日	昨日	变化量
O/N	1.4320	1.4130	0.0190
1M	1.8700	1.8650	0.0050
3M	1.9990	1.9980	0.0010
6M	2.1330	2.1300	0.0030
USD SOFR (%)			
	今日	昨日	变化量
O/N	0.7900	0.8000	-0.0100
1M	1.1426	1.1261	0.0165
3M	1.4723	1.4602	0.0121
6M	1.8707	1.8516	0.0191
USD 利率掉期 (%)			
	今日	昨日	变化量
1 年掉期	2.8141	2.7818	0.0323
2 年掉期	3.1544	3.1284	0.0260
3 年掉期	3.1592	3.1380	0.0212
5 年掉期	3.1035	3.0817	0.0218
10 年掉期	3.1141	3.0949	0.0192
USDCNH 交叉货币掉期 (%)			
	今日	昨日	变化量
1 年掉期	2.8000	2.7500	0.0500
2 年掉期	3.0750	3.0250	0.0500
3 年掉期	3.0900	3.0350	0.0550
5 年掉期	2.9100	2.8500	0.0600
10 年掉期	2.5750	2.5150	0.0600

经济新闻

- 美财长叶伦称降低中国商品关税不是缓解通胀的“万能药” 美国财政部长叶伦表示，拜登政府正在寻求“重新设定”针对中国输美商品的

关税，但她警告称，但这并不是缓解高通胀的“万能药”。“我认为部分关税最终是由美国人支付的，而不是中国人，这伤害了美国消费者和企业，”叶伦表示，并补充称，政府正在寻求“以一种更具战略性的方式重新设置这些关税。”她表示，关于关税计划的更多信息将在未来几周内公布，并补充称“正在积极考虑”这些调整。她表示，通胀不会成为美国的一个长达十年的问题，拜登政府的新冠救助支出对物价上涨仅有“轻微”贡献。

- 美国暂停三家企业的出口权，因向中国非法出口敏感技术 美国商务部表示，将暂停三家总部位于美国的企业的出口权，为期 180 天，理由是这些企业向中国非法出口卫星、火箭和国防技术。中国驻美大使馆没有立即置评。记者无法立即联系到三家企业置评。
- 中国国常会：经济压力仍突出、政策要再细化落实，确保二季度经济合理增长 新冠疫情重压下中国稳经济的六大项 33 类举措已悉数出台。总理李克强主持召开的国务院常务会议指出，经济下行压力依然突出，各地要推动稳经济政策再细化再落实，确保二季度经济合理增长，稳住经济大盘。会议并称，要进一步扩大对外开放，在落实已出台稳外贸稳外资政策同时加大支持，协调解决外贸外资企业复工达产、项目建设等困难。
- -中国今日将公布贸易收支数据：5 月出口同比增速料升至 8%，进口亦温和升至 2% 路透综合近 30 家机构预估中值显示，随着国内复工复产的推进，疫情对物流、生产等方面带来的影响逐渐减轻，中国 5 月出口同比增速料回升至 8%，进口同比增速亦温和升至 2%；贸易顺差

料扩大至 580 亿美元。

- 俄罗斯军队将乌军逼退至北顿涅茨克郊区，战况再次逆转乌克兰卢甘斯克州州长称，面对俄罗斯军队的猛烈攻击，乌克兰军队撤到了东部城市北顿涅茨克的郊区，俄乌战争中最血腥一次战斗局面再次转向。在上周出人意料宣布展开反击后，卢甘斯克州州长 Serhiy Gaidai 周三表示，该市的大部分地区再次落入俄罗斯人手中。
- 美国称正“非常密切”地关注朝鲜核试验的可能性；中国称美国需放松对朝制裁美国国家安全顾问沙利文表示，美国正在“非常密切地”关注朝鲜继续进行核试验的可能性，并将作出强有力的回应。中国驻联合国大使张军在联合国大会上说，美国需要对朝鲜采取行动，如放松某些领域的制裁，并结束与韩国的联合军事演习。“关键是要采取行动，”张军说，华盛顿不能“仅是嘴上说它准备与平壤进行无前提条件的对话”。
- SEC 主席公布美国股票交易规则整改提议，零佣金券商财路恐被截断美国最高证券监管机构公布了一项拟议中的华尔街散户股票交易规则改革计划，目标增强免佣金券商处理订单方面的竞争，以确保散户投资者获得最好的交易价格。这标志着美国股票市场规则将迎来十多年来最重大的一次调整，SEC 可能会在今年秋天公布正式提案。随后将征集公众意见，最后再由 SEC 进行表决，决定是否采用。
- 国际货币基金组织(IMF)第一副总裁戈皮纳特表示，根据目前的预测，美国的通胀率可能会长期保持在美联储的目标之上，且该国存在通胀预期“脱锚”的风险。

- 白宫发言人让皮埃尔表示，白宫预计下一轮经济数据将显示通胀仍高企。她称，将在本周末公布的通胀数据可能会提供更多通胀高企的证据。
 - 俄罗斯未与两个印度买家签署石油供应协议，因无油可卖三位知情人士表示，俄罗斯国家石油公司(Rosneft，俄油)正在推迟与两家印度国有炼油厂签署新的原油供应交易，因为该公司已经承诺向其他客户销售。无法与俄油签署新的定期供应协议，可能会促使印度炼油商转向现货市场购买更昂贵的石油。这也表明，尽管西方旨在扼杀莫斯科收入的制裁压力越来越大，但俄罗斯还是设法继续出口石油。
 - 国际金融协会(IIF)表示，俄罗斯经济今年将萎缩 15%，2023 年将萎缩 3%，因西方制裁的打击、公司撤出、“人才外流”和出口锐减，将使过去 15 年的经济成果化为乌有。IIF 称，预计未来几个月战争不会停火，而且制裁范围可能会扩大，且力度可能会加大。
 - 经济合作暨发展组织(OECD)表示，面对高通胀，英国经济将在 2023 年停滞不前，落后于同类国家，政府应考虑放宽增税或增加支出。经合组织预计，英国国内生产总值(GDP)今年将增长 3.6%，2023 年增幅为 0.0%，是 20 国集团(G20)中除俄罗斯外所有国家中的最慢增长预期。
- 男子驾车冲进柏林人群，造成一名教师死亡 14 名学生受伤 德国官员们表示，一名 29 岁的男子周三在柏林开车冲进人群，造成一名教师死亡，她的 14 名学生受伤，这名男子的车两次猛然转向开上一个购物区的人行道。“最新证据表明，这是一起精神病患者失控的案例，”柏林内政部长 Iris Spranger 表示。

- 推特高管告诉员工，计划在 7 月底或 8 月初就其 440 亿美元出售给马斯克的交易举行股东投票，目前该公司继续“积极”努力完成与这位世界首富的交易。马斯克的律师此前警告推特，如果该公司不能提供他所要求的关于垃圾邮件和虚假账户的数据，他可能会放弃这项收购。推特表示，正继续与马斯克分享信息。
- 上海清算所信息显示，5 月有新开发银行和亚洲基础设施投资银行两家国际开发机构在中国债市发债，其中亚投行所发行的 15 亿元人民币熊猫债，为中国银行间市场以“框架发行”方式发行可持续发展债券首单。
- 百度旗下智能汽车品牌集度宣布，其首款汽车机器人概念车 ROBO-01 正式发布，并展示了 3D 无界一体式大屏、主动可变形结构设计等产品配置。

市场摘要

■ 股市:

- 美国股市周三收低，美债收益率升穿具有重要心理意义的 3% 关口，且油价跳涨，引发了对通胀和利率前景的担忧。市场普跌，标普 500 指数跌幅超过 1%，结束了此前连续两日的涨势。英特尔急挫 5.3%，造成最大拖累，此前花旗银行在一周内第二次下调了对该芯片制造商的预测。道琼斯工业指数下跌 269.24 点，或 0.81%，至 32,910.9 点；标普 500 指数下跌 44.91 点，或 1.08%，至 4,115.77 点；纳斯达克指数回落 88.96 点，或 0.73%，至 12,086.27。

➤ 欧洲股市下跌，围绕经济增长放缓的担忧和瑞士信贷的黯淡财测拖累了银行股，同时投资者为欧洲央行周四的会议和美联储下周的会议做准备。泛欧 STOXX 600 指数收低 0.6%。德国 DAX 指数收低 0.76%，法国 CAC 40 指数收挫 0.8%，英国富时指数微跌 0.08%。

■ 汇市：

➤ 美元指数上涨，扭转了早些时候的跌势，因为美国股市下跌，提振了美元的避险吸引力，而欧元在欧洲央行公布政策前走强。美元兑日元创 20 年新高，日元盘中跌至 134.47，为 2002 年 2 月 27 日以来最弱水准，欧元兑日元达到 2015 年 1 月 5 日以来的最高水平。日元兑欧元已经连续 10 个交易日下跌，这是八个月以来最长的连跌。欧元兑日元上涨 1.3% 至 143.780 日元。日元兑美元下挫 1.17%，报 134.17 日元；英镑兑美元纽约尾盘报 1.2541 美元，当日下跌 0.37%。

■ 债市：

➤ 美国公债收益率上升，此前财政部标售 10 年期公债需求不温不火，而且投资者在等待周五备受期待的通胀数据。指标 10 年期美债收益率上涨 6 个基点至 3.029%。两年期公债收益率上涨 4 个基点，至 2.774%。

➤ 欧元区公债收益率攀升，货币市场加大了对欧洲央行升息的押注，目前预期到 9 月将总计升息 75 个基点。欧元区指标德国 10 年期公债收益率稍早创下 1.368% 的 2014 年以来新高，截至 1514 GMT，上涨 6 个基点。意大利 10 年期收益率上涨 7 个基点，报 3.473%，但低于周二触及的 2018 年以来最高 3.55%。意大利/德国 10 年期公债收益率差

报 211 个基点，本周稍早为 220 个基点。油市：

- 油价跳涨超过 2%，达到 13 周高点，因为尽管汽油价格创新高，但美国对汽油的需求仍在不断增加，而在预期中国的原油需求将增加的情况下，投资人愈发担心包括伊朗在内的几个国家的供应。布兰特原油期货上涨 3.01 美元，或 2.5%，报收每桶 123.58 美元，美国原油期货上涨 2.70 美元，或 2.3%，报收每桶 122.11 美元。

■ 黄金：

- 黄金震荡小涨，因为在美国通胀数据公布之前，对经济增长的担忧提振了黄金的避险吸引力，而美国通胀数据可能为美联储的加息时间表提供指引。现货金收盘上涨约 0.1%，至每盎司 1,853.26 美元。美国期金收盘上涨 0.2%，报每盎司 1,856.50 美元。--铜价反弹，投资者对最大消费国中国的需求复苏抱有希望，且美元回吐涨幅。1600 GMT，伦敦金属交易所(LME)三个月期铜上涨 0.4%，至每吨 9,738 美元，此前曾低见 9,642 美元。(END/DKY)