

原油日报：SC 原油大幅下挫 宏观风险因素仍存

2023年5月12日 星期五

一、每日数据监测



原油期货日度数据监测

指标		截止	单位	上一日	最新	涨跌量	涨跌幅
宏观指标	标普指数	5/11	-	4137.64	4130.62	-7.02	-0.17%
	美元指数	5/11	-	101.4375	102.0789	0.6414	0.63%
	人民币汇率	5/12	-	6.9101	6.9481	0.038	0.55%
国际油品期货	Brent	5/11	美元/桶	76.59	75.43	-1.16	-1.51%
	WTI	5/11	美元/桶	72.79	71.42	-1.37	-1.88%
	RBOB	5/11	美元/加仑	2.4961	2.4669	-0.0292	-1.17%
中国原油期货	SC2304	5/12	元/桶	513	494.8	-18.2	-3.55%
	成交量	5/12	手	137300	134633	-2667	-1.94%
	持仓量	5/12	手	28282	28502	220	0.78%

数据来源：wind，文华财经，金石期货研究所

二、相关图表概览

图 1：原油内外盘期货价格

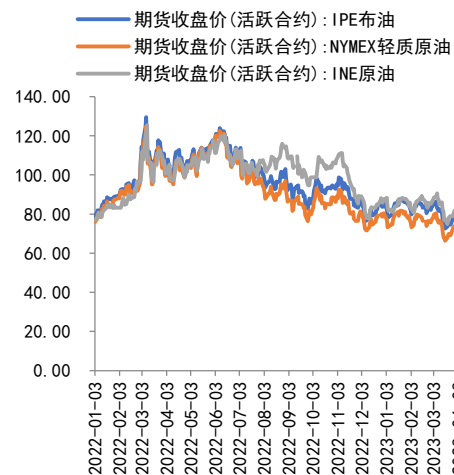


图 2：原油现货价格概览

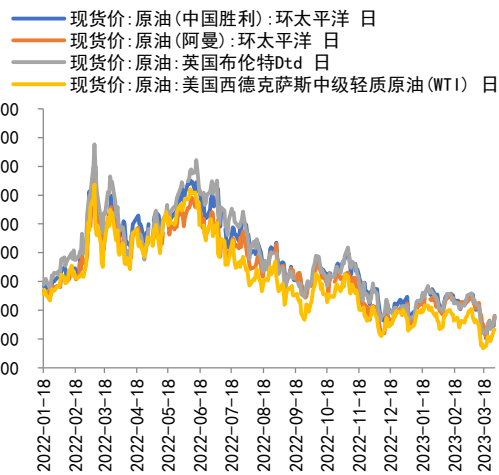


图 3: INE 原油月差

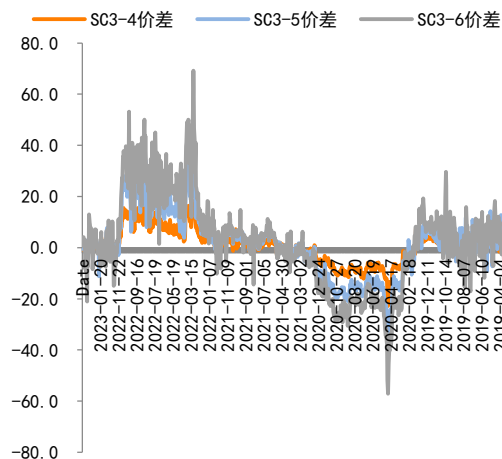


图 4: WTI 原油月差

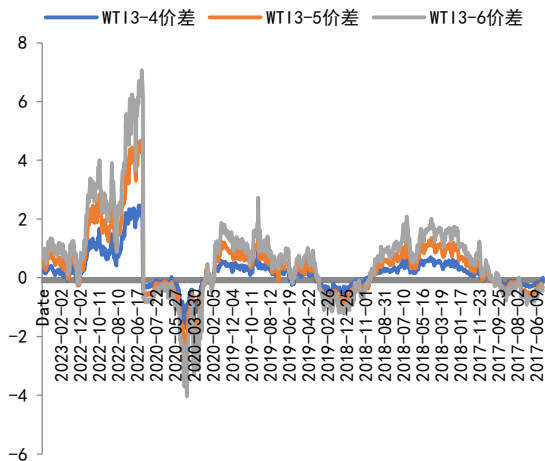


图 5: Brent 原油月差

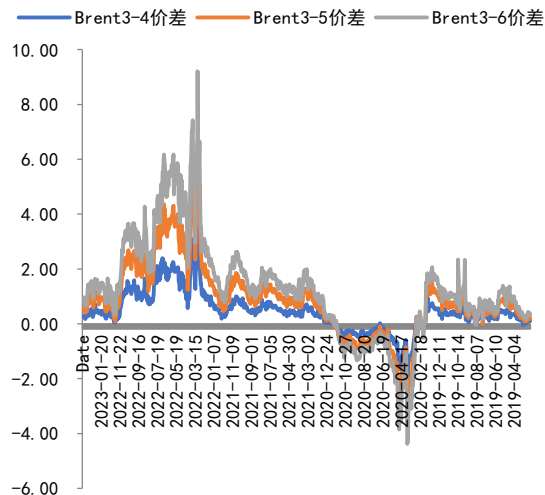


图 6: 黄金—原油价格走势

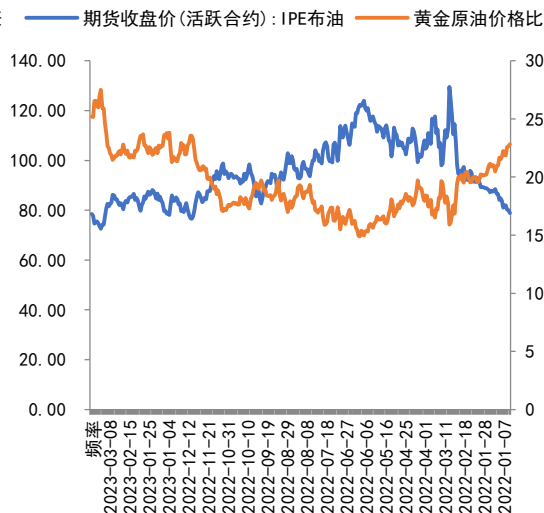


图 7: 铜—原油价格走势

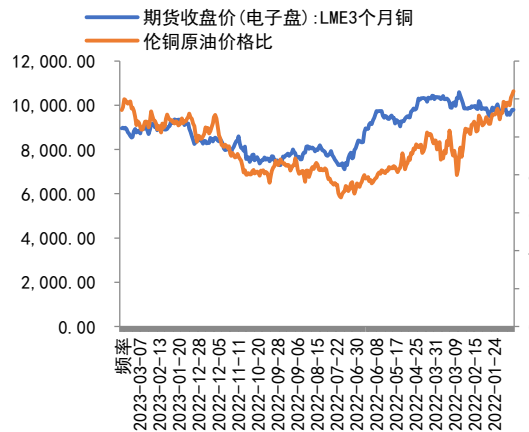


图 8: 美元指数—原油价格走势

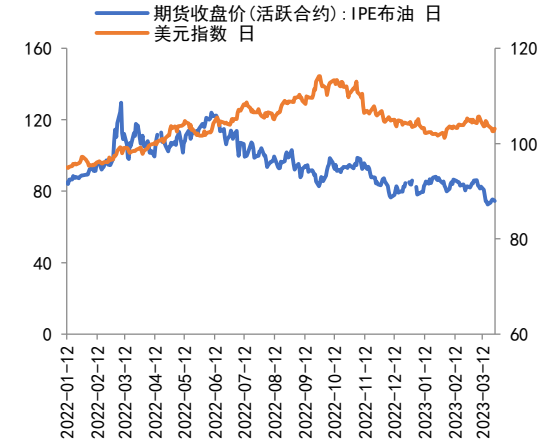


图 9：国内原油基差

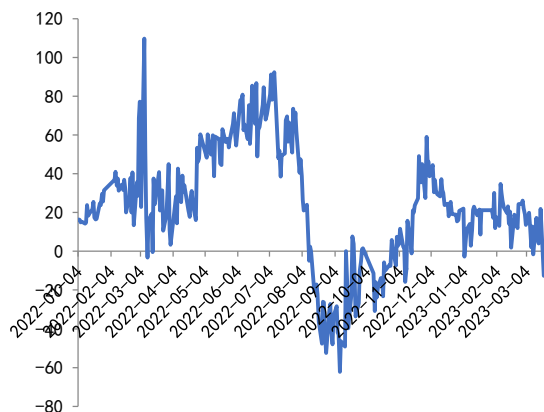


图 10：Brent-WTI 价差

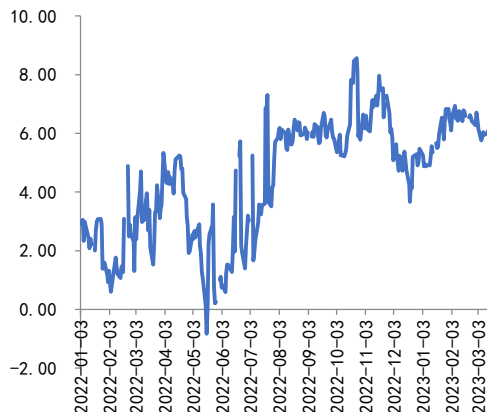


图 11：美国通胀率

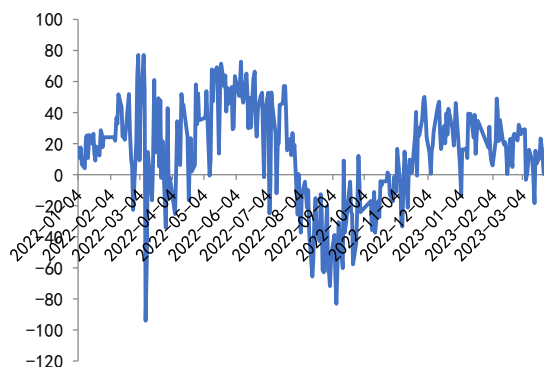
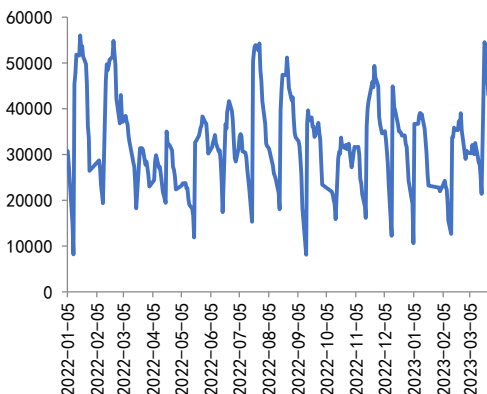


图 12：国内原油期货持仓量



数据来源：wind、金石期货研究所

三、行业资讯

1、美国能源部长：可能从 6 月开始购买原油以补充储备，美国能源部长格兰霍姆(Jennifer Granholm)表示，在国会对于动用战略石油储备的授权 6 月结束后，能源部将能够购买石油以补充战略石油储备。“届时我们将改变方向，希望能够购买原油，” 格兰霍姆在众议院小组委员会作证时称。

2、沙特阿美或将其能源贸易业务 IPO 计划推迟至明年，沙特阿美正在推迟其能源贸易业务在利雅得的首次公开募股（IPO）计划。知情人士表示，该公司还没有为上市设定新的时间表，除非市场好转，否则可能会推迟到明年。据了解，近一年多，全球油企的贸易部门获利甚丰，有投行分析，英国石油、壳牌和道达尔去年从油气、炼油贸易获利达 370 亿美元，但目前甚少油企将贸易部门独立上市。

3、欧佩克月报：预计中国 2023 年的石油需求将增加 80 万桶/日，OPEC 月报上调中国对原油的需求。预计中国 2023 年的石油需求将增加 80 万桶/日（之前预测为 76 万桶/日）。2023 年全球石油需求增速预期维持在 230 万桶/日不变。

四、行情展望

2023 年 5 月 12 日星期五，对经济和需求前景的担忧，隔夜国际原油价格承压，周五内盘原油系全线弱势下探，市场避险情绪和供应端利好相互抵消。SC 原油主力合约大幅下挫 3.83%，报收 494.8 元。宏观环境风险仍存是压制原油价格的主要原因，美国上周首次申领失业金人数创 2021 年 10 月最高，说明劳动力市场持续降温。市场对于经济衰退有序仍存，中国最近社融数据等经济数据加剧市场对于经济复苏前景的担忧。需求端，OPEC 发布最新月报，连续三个月维持对于 2023 年全球石油需求的预估不变，预计将增加 2.3%，其中调升中国 2023 年需求，调降其他地区需求。当前原油基本面变化不大，宏观环境主导原油价格走势，后期重点关注宏观风险因素。

关注金石期货微信公众号



金石期货公众号



金石期货投资咨询部公众号

免责声明：

本报告中的信息均来源于已公开的资料，尽管我们相信报告中资料来源的可靠性，但我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。也不保证我公司所做出的意见和建议不会发生任何的变更，在任何情况下，我公司报告中的信息和所表达的意见和建议以及所载的数据、工具及材料均不能作为您所进行期货买卖的绝对依据。由于报告在编写时融入了该分析师个人的观点和见解以及分析方法，如与金石期货公司发布的其他信息有不一致及有不同的结论，未免发生疑问，本报告所载的观点并不代表了金石期货公司的立场，所以请谨慎参考。我公司不承担因根据本报告所进行期货买卖操作而导致的任何形式的损失。

另外，本报告所载资料、意见及推测只是反映金石期货公司在本报告所载明的日期的判断，可随时修改，毋需提前通知。未经金石期货公司允许批准，本报告内容不得以任何范式传送、复印或派发此报告的材料、内容或复印本予以任何其他人，或投入商业使用。如遵循原文本意的引用、刊发，需注明出处“金石期货有限公司”，并保留我公司的一切权利。