

原油日报：宏观恐慌情绪升温 SC 原油持续下挫

2023年8月3日星期四

一、每日数据监测

金石期货
JINSHI FUTURES

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	8/2	-	4576.73	4513.39	-63.34	-1.38%
	美元指数	8/2	-	102.2125	102.6348	0.4223	0.41%
	人民币汇率	8/3	-	7.1368	7.1495	0.0127	0.18%
国际油品期货	Brent	8/2	美元/桶	85.68	83.38	-2.3	-2.68%
	WTI	8/2	美元/桶	82.17	79.75	-2.42	-2.95%
	RBOB	8/2	美元/加仑	2.9095	2.7796	-0.1299	-4.46%
中国原油期货	SC2309	8/3	元/桶	625	605.5	-19.5	-3.12%
	成交量	8/3	手	149918	195465	45547	30.38%
	持仓量	8/3	手	40395	33616	-6779	-16.78%

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

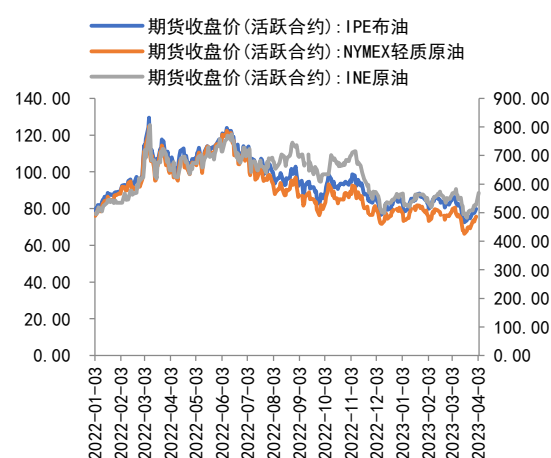


图 2：原油现货价格概览

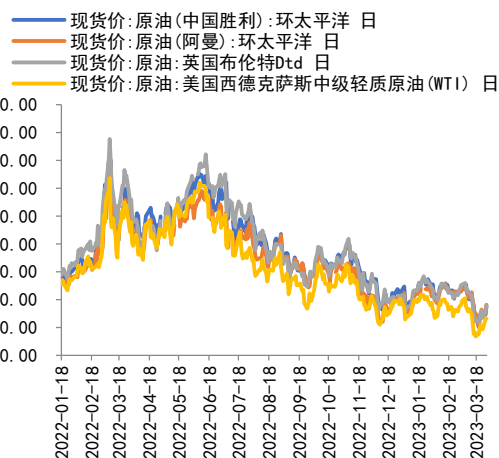


图 3: INE 原油月差

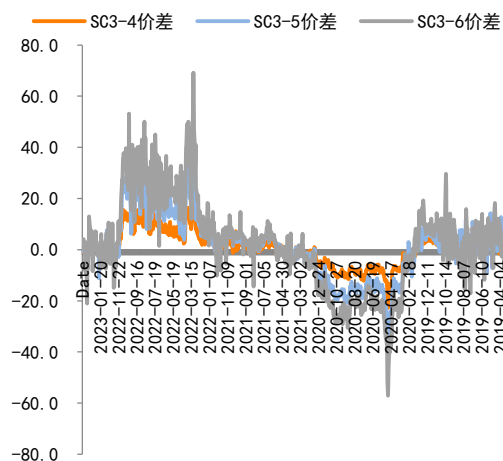


图 4: WTI 原油月差

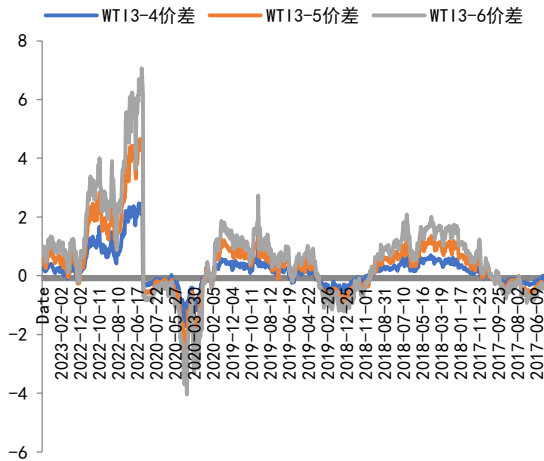


图 5: Brent 原油月差

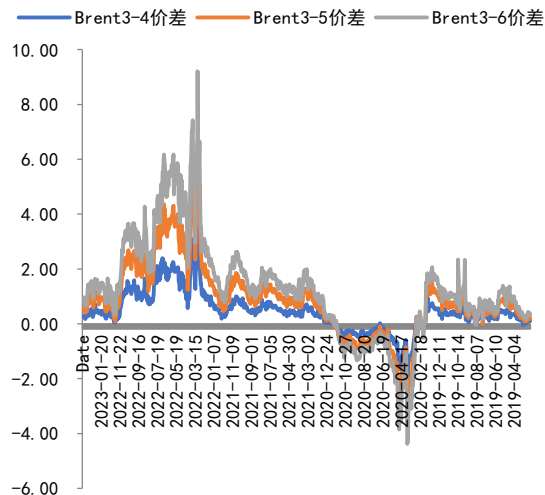


图 6: 黄金—原油价格走势

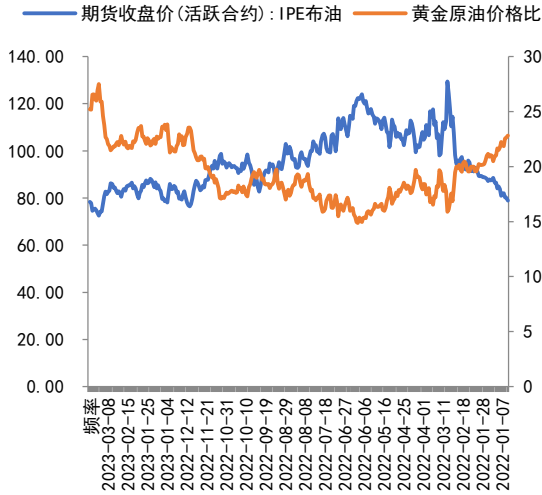


图 7: 铜—原油价格走势

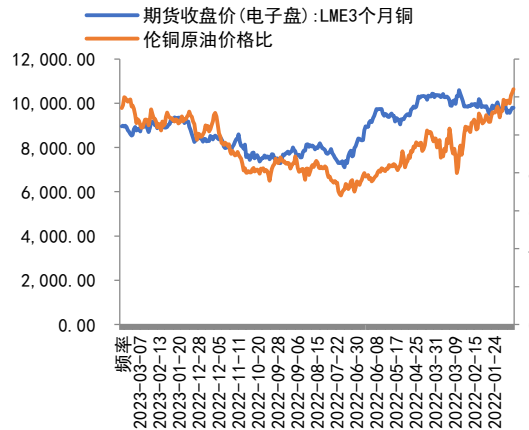


图 8: 美元指数—原油价格走势

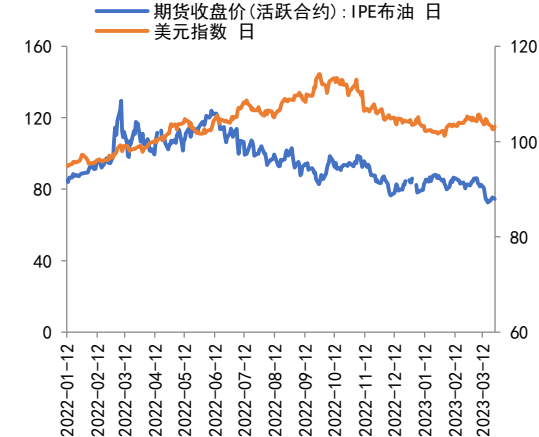


图 9：国内原油基差

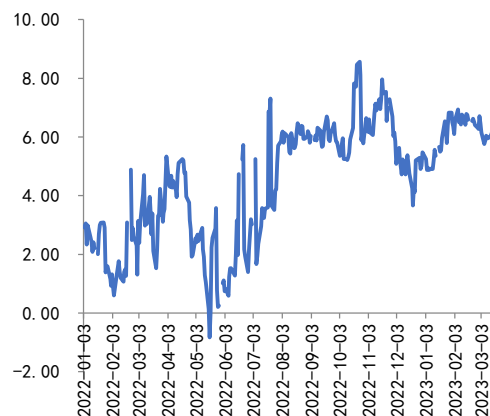
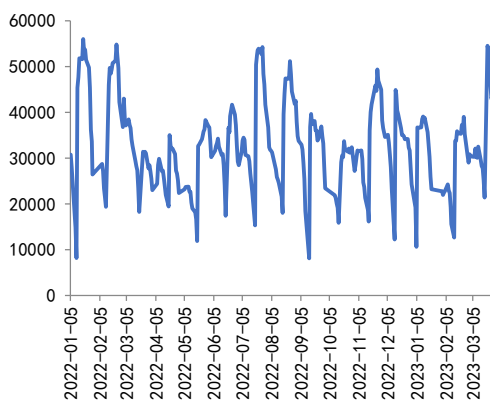
图 10：Brent-WTI 价差

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、财联社鹰眼讯，路透援引消息人士称，OPEC+小组在周五的会议上不太可能调整产油政策，因供应趋紧和需求强劲推动油价上涨。

2、美国至 7 月 28 日当周 EIA 原油库存减少 1704.9 万桶，预期减少 136.7 万桶。

3、美国 8 月面向亚洲的原油出口或创纪录新高，行业咨询公司 Vortexa 高级石油市场分析师 Rohit Rathod 表示，预计美国原油出口商本月面向亚洲的原油出口量达到创纪录的 220 万桶/日，因为该地区正在寻求替代沙特减产的石油。

4、CME“美联储观察”：美联储9月维持利率不变的概率为81.5%，据CME“美联储观察”：美联储9月维持利率在5.25%-5.50%不变的概率为81.5%，加息25个基点至5.50%-5.75%区间的概率为18.5%；到11月维持利率不变的概率为71.6%，累计加息25个基点的概率为26.2%，累计加息50个基点的概率为2.3%。

四、行情展望

2023年8月3日星期四，隔夜国际油价出现明显回落，WTI原油期货跌破80美元/桶。周一SC原油延续跌势，SC原油主力合约大幅下探2.39%，报收605.5元。宏观方面，美国信用评级从AAA下调至AA+，市场恐慌情绪升温。市场认为美联储将在未来继续加息，美元指数反弹，创近一个月新高。供应方面，OPEC+及其减产同盟进一步减产，预计供应收紧，对油价形成支撑。需求方面，作为原油消费大国，中国原油进口量维持高位，美国原油正处于需求旺季。当前原油基本面未出现波动，但宏观风险因素仍存，建议保持观望。

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

钱龙 期货从业资格号：F3077614；投资咨询证书号：Z0017608

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。