

原油日报：SC 原油偏强运行 宏观市场风险仍存

2023年8月9日 星期三

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	8/8	-	4518.44	4499.38	-19.06	-0.42%
	美元指数	8/8	-	102.0731	102.5367	0.4636	0.45%
	人民币汇率	8/9	-	7.1565	7.1588	0.0023	0.03%
国际油品期货	Brent	8/8	美元/桶	85.91	86.18	0.27	0.31%
	WTI	8/8	美元/桶	82.47	82.84	0.37	0.45%
	RBOB	8/8	美元/加仑	2.8278	2.8382	0.0104	0.37%
中国原油期货	SC2309	8/9	元/桶	621.4	631.3	9.9	1.59%
	成交量	8/9	手	121618	155098	33480	27.53%
	持仓量	8/9	手	34352	36001	1649	4.80%

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

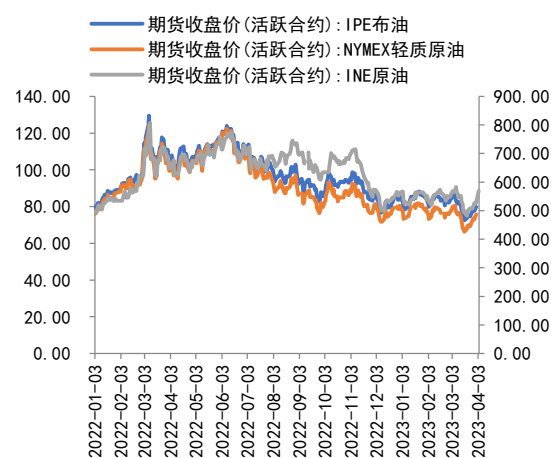


图 2：原油现货价格概览

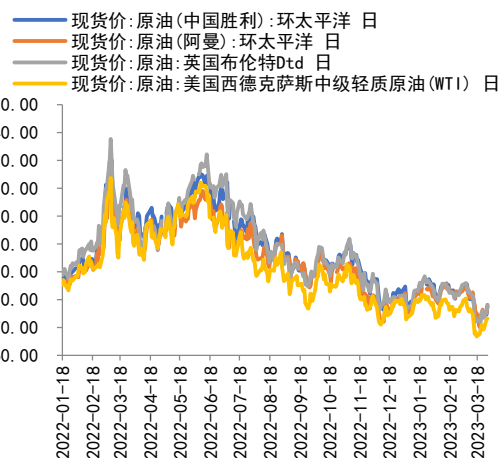


图 3: INE 原油月差

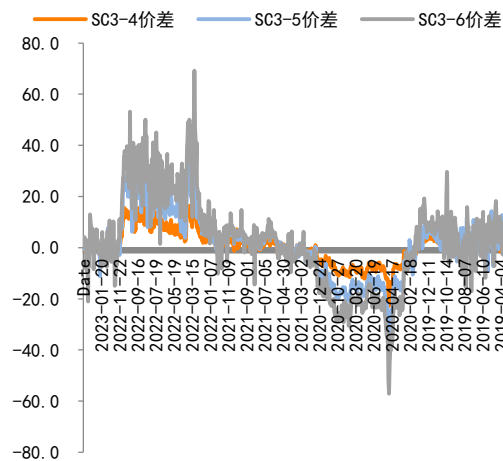


图 4: WTI 原油月差

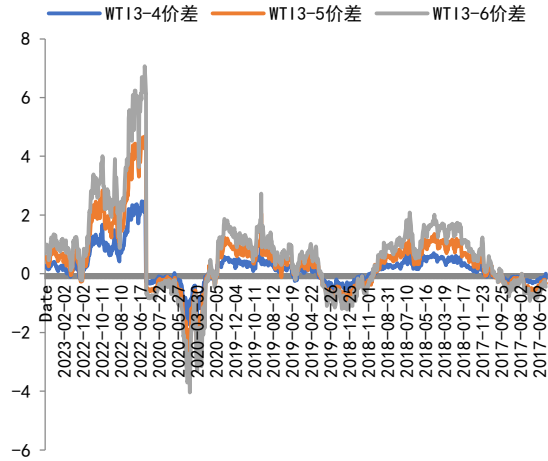


图 5: Brent 原油月差

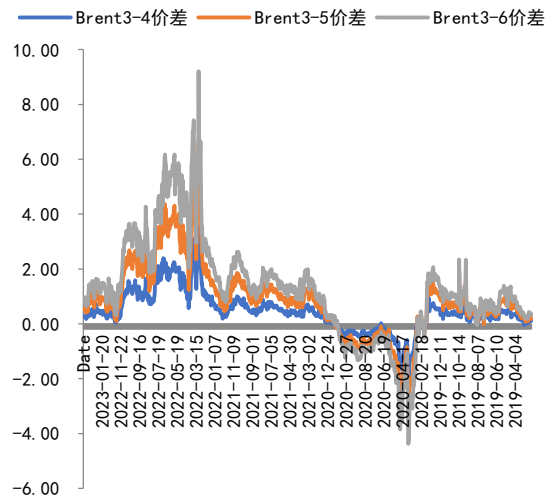


图 6: 黄金—原油价格走势

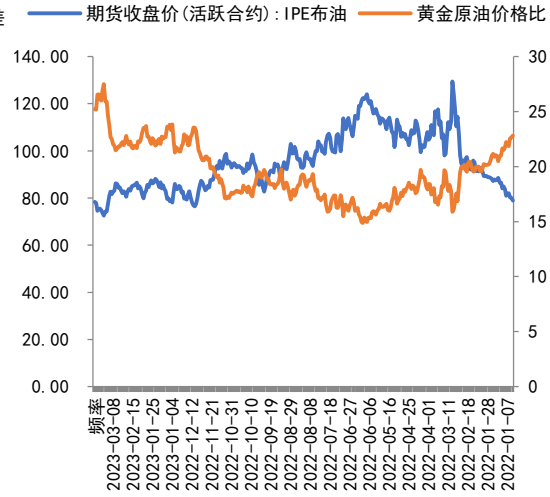


图 7: 铜—原油价格走势

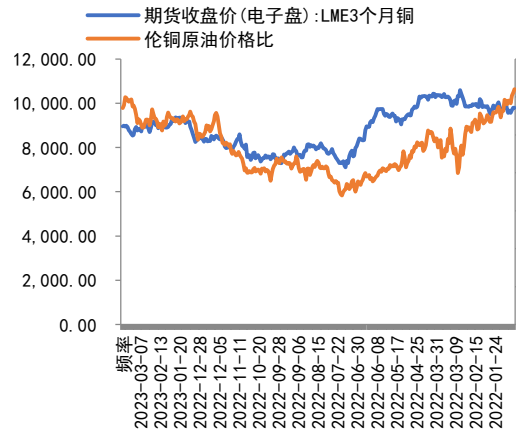


图 8: 美元指数—原油价格走势

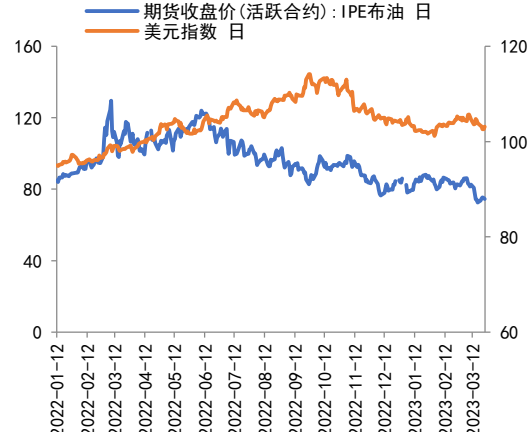


图 9：国内原油基差

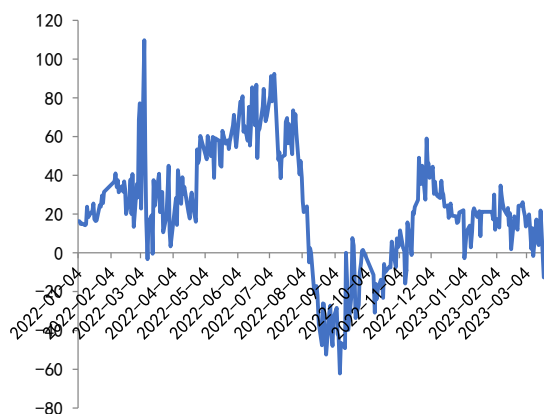


图 10：Brent-WTI 价差

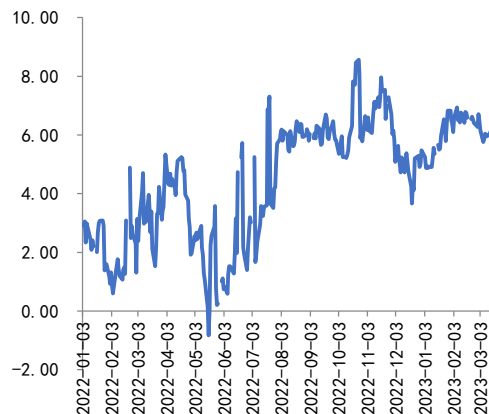


图 11：美国通胀率

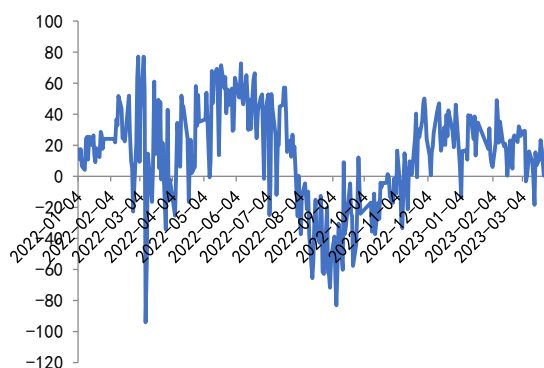
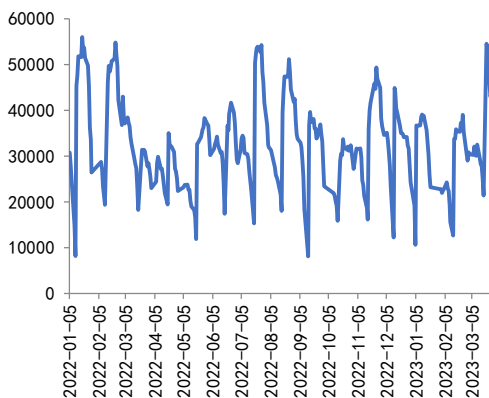


图 12：国内原油期货持仓量



数据来源：wind、金石期货研究所

三、行业资讯

1、由于沙特的减产 欧佩克+原油产量降至 2021 年 8 月以来的最低水平，普氏能源调查显示，由于沙特的重大自愿减产生效，欧佩克+7 月原油产量削减至近两年低点。沙特最近的减产以及哈萨克斯坦和尼日利亚的供应中断抵消了伊朗和伊拉克的增产，导致欧佩克+产量环比下降近 100 万桶/日。调查发现，欧佩克 13 个成员国的日产量为 2734 万桶，而俄罗斯和其他 8 个盟国的日产量为 1306 万桶，总计为 4040 万桶。这是该集团自 2021 年 8 月以来的最低水平。此外，沙特的产量降至 905 万桶/日，这是自 2021 年 6 月以来的最低水平。

2、EIA：预计 2023 年美国原油产量为 1276 万桶/日，EIA 短期能源展望报告显示，预计 2023 年美国原油产量为 1276 万桶/日，此前预期为 1256 万桶/日；预计 2024 年美国原油产量为 1309 万桶/日，此前预期为 1285 万桶/日。预计 2023 年美国原油产量将增加 85 万桶/日，此前预期为增加 67 万桶/日；预计 2024 年美国原油产量将增加 33 万桶/日，此前为增加 29 万桶/日。预计 2023 年美国原油需求增速为 19 万桶/日，此前为 16 万桶/日；预计 2024 年美国原油需求增速为 28 万桶/日，此前为 35 万桶/日。

3、CME“美联储观察”：美联储 9 月维持利率不变的概率为 86%，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 86%，加息 25 个基点至 5.50%-5.75%区间的概率为 14%；到 11 月维持利率不变的概率为 69.2%，累计加息 25 个基点的概率为 28%，累计加息 50 个基点的概率为 2.7%。

四、行情展望

2023 年 8 月 9 日星期三，隔夜国际油价波动较大，宏观情绪波动剧烈，内盘原油系整体运行偏弱。周三内盘原油系整体市场情绪有所好转，SC 原油主力合约收涨 0.99%，报收 631.3 元。宏观方面，近期宏观风险因素一定程度上打压原油市场，美国信用评级降级，市场恐慌情绪升温。虽然美欧央行加息均接近尾声，但高利率对下半年经济压力仍存。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。



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。