



资讯早间报

制作日期：2023/6/27

隔夜夜盘市场走势

- 国际油价全线上涨，美油8月合约涨0.53%，报69.53美元/桶。布油9月合约涨0.64%，报74.48美元/桶。
- 国际贵金属期货普遍收涨，COMEX黄金期货涨0.17%报1932.9美元/盎司，COMEX白银期货涨2.11%报22.825美元/盎司。
- 伦敦基本金属全线收跌，LME期铜跌0.03%报8388美元/吨，LME期锌跌1.29%报2334美元/吨，LME期镍跌4.39%报20375美元/吨，LME期铝跌1.31%报2146美元/吨，LME期锡跌2.95%报25695美元/吨，LME期铅跌2.24%报2075.5美元/吨。
- 芝加哥期货交易所（CBOT）农产品期货主力合约收盘涨跌不一，大豆期货涨0.97%报1322.75美分/蒲式耳；小麦期货跌1.41%报736美分/蒲式耳。
- 国内商品期货夜盘收盘涨跌不一，能源化工品多数下跌，乙二醇跌1.02%，玻璃跌1.01%，甲醇涨1.17%。黑色系涨跌不一。农产品多数上涨，菜油涨1.32%，玉米涨1.19%，玉米淀粉涨1.13%，棕榈油涨1.04%。基本金属多数收跌，沪镍跌2.23%，沪锡跌1.97%，沪铅跌0.83%，沪铝跌0.25%，沪铜跌0.22%，沪锌跌0.12%，不锈钢涨0.03%。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货投资咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



重要资讯

【宏观资讯】

1. 审计署发布 2022 年度审计报告显示，2022 年，中央一般公共预算收入总量 107552.14 亿元、支出总量 134052.14 亿元，赤字 26500 亿元，与预算持平。
2. 财政部部长刘昆在关于 2022 年中央决算的报告指出，2022 年中央决算情况总体较好。下一步将重点做好六项工作：加力提效实施积极的财政政策，加强重点领域支出保障，兜牢基层“三保”底线，有效防范化解地方政府债务风险，加大财会监督力度。
3. 俄罗斯瓦格纳集团的创始人普里戈任表示，瓦格纳集团注定在 7 月 1 日不复存在，没有人同意与国防部签署（收编）合同。

【能化期货】

1. 远兴能源表示，阿拉善天然碱项目落地有助于公司进一步巩固和增强核心竞争力，为公司长远发展提供支撑和保障，新增产能将对下游市场供需结构带来一定影响。
2. 财联社记者在传化供应链伙伴大会上了解到，当前传统产业过剩风险加剧，根据传化对客户的实地走访，各主要下游行业总体开工率在低水平徘徊：纺织市场目前开机率大约在 70% 左右，化纤行业 PTA 生产负荷下调到 77%。
3. 据市场消息，俄罗斯将延长对油价上限的反制措施，直到（今年）12 月 31 日。



【金属期货】

1. 据 SMM 调研，近期市场传闻河南地区矿山受到复垦要求的影响，矿山开采受限，当地矿石产量有所减少。截止到目前，部分氧化铝企业转而采购外地矿以维持生产，河南省尚未出现大面积减产的情况。但若矿山生产持续受限，外采矿无法满足生产的情况下，不排除河南氧化铝厂会有减产计划。

【黑色系期货】

1. 内蒙古发布关于进一步加强全区井工煤矿安全管理若干措施的通知，其中提及，煤矿发生生产安全事故后，煤矿安全监管监察部门应依法依规责令煤矿停工停产整顿。发生较大生产安全事故的煤矿，停工停产整顿期限原则上不少于6个月。

2. 据 SMM，上周龙头焦企旭阳焦化对水焦提涨 50 元/吨，干焦提涨 60 元/吨，暂时没有钢厂接受。焦炭的首轮提涨尚未落地。另外，有市场传言称：外蒙古焦煤长协价格第三季度由 89 美金/吨下调到 80 美金/吨，对期货市场负面情绪影响较大。

3. 据 Mysteel 调研，6 月 26 日唐山多数调坯轧钢厂执行停产措施，其中由于近期轧钢厂亏损以及成品库存高企，部分厂家此前已经停产。

4. 据 Mysteel，6 月 19 日-6 月 25 日澳洲巴西 19 港铁矿发运总量 2677.8 万吨，环比减少 184.1 万吨。澳洲发运量 1817.8 万吨，环比减少 306.9 万吨，其中澳洲发往中国的量 1547.5 万吨，环比减少 247.5 万吨。巴西发运量 860.0 万吨，环比增加 122.7 万吨。本期全球铁矿石发运总量 3231.0 万吨，环比减少 63.6 万吨。

5. 据 Mysteel，6 月 19 日-6 月 25 日中国 47 港铁矿石到港总量 2368.1 万吨，环比增加 98.6 万吨；中国 45 港铁矿石到港总量 2249.3 万吨，环比增加 68.5 万吨；北方六港铁矿石到港总量为 1103.1 万吨，环比增加 71.2 万吨。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货投资咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



【农产品期货】

1. 据国家发改委数据，截至 6 月 21 日，全国生猪出场价格为 14.36 元/公斤，较 6 月 14 日上涨 0.28%；主要批发市场玉米价格为 2.82 元/公斤，较 6 月 14 日上涨 0.71；猪粮比价为 5.09，较 6 月 14 日下跌 0.39%。
2. 据 Wind 数据显示，截至 6 月 23 日当周，自繁自养生猪养殖利润为亏损 296.06 元/头，6 月 16 日为亏损 325.66 元/头；外购仔猪养殖利润为亏损 256.18 元/头，6 月 16 日为亏损 240.26 元/头。
3. 昨日，网上一份四川省南部县关闭猪肉经营场所 24 小时的文件引发热议，财联社记者从南部县农业农村局相关人士处获悉，“网上流传南部县将关闭全县猪肉经营场所 24 小时的文件是真实的。”南部县多位猪肉经销商则向记者表示。
4. 据 Mysteel，截至 2023 年 6 月 23 日（第 25 周），全国重点地区豆油商业库存约 98.67 万吨，较上次统计增加 5.02 万吨，涨幅 5.36%；全国重点地区棕榈油商业库存约 48.89 万吨，较上周减少 3.14 万吨，减幅 6.03%。
5. 根据 Mysteel 农产品对全国主要油厂的调查情况显示，第 25 周（6 月 17 日至 6 月 23 日）111 家油厂大豆实际压榨量为 192.84 万吨，开机率为 64.80%。
6. 印尼能源部长周一表示，该国计划在未来几年将生物燃料掺混比例上调至 40%，但现阶段掺混率将保持在 35% 不变。印尼于今年 2 月将生物燃料掺混率从 30% 调至 35%，但部分地区尚未全面执行该政策。
7. 印尼海洋事务和投资协调部长 Luhut Binsar Pandjaitan 表示，随着欧洲国家实施欧盟无森林砍伐条例 (EUDR)，政府正在考虑逐步将印尼的棕榈油出口转移到非洲。从印尼出口到欧洲的棕榈油量每年可达到 330 万吨。



8. 据南部半岛棕榈油压榨商协会（SPPOMA）数据显示，2023年6月1-25日马来西亚棕榈油单产增加0.75%，出油率减少0.11%，产量增加0.20%。

9. 据马来西亚独立检验机构AmSpec显示，马来西亚6月1日至25日棕榈油出口量为891361吨，环比下降4.5%。

10. 据船运调查机构ITS数据显示，马来西亚6月1-25日棕榈油出口量为897180吨，上月同期为982605吨，环比下降8.69%。

11. 据广西壮族自治区气象局决策服务中心，6月19日以来我区出现“龙舟水”降雨集中期的持续性强降雨天气过程，过程具有持续时间长、暴雨范围广、累计雨量大等特点。受持续性强降雨影响，全区大部蔗区干旱得到解除或基本缓解；同时，大部蔗区出现了轻度至中度涝渍灾害。

12. 加拿大油籽加工协会（COPA）发布的油籽压榨数据显示，2023年5月，加拿大油菜籽压榨量为769942.0吨，环比降13.15%；菜籽油产量为323217.0吨，环比降13.04%；菜籽粕产量为450526.0吨，环比降13.88%。加拿大大豆压榨量为144992.0吨，环比降7.54%；豆油产量为27510.0吨，环比降6.93%；豆粕产量为112180.0吨，环比降7.89%。

13. 农业咨询机构AgRural周一表示，截至上周四，巴西中南部地区农民已收割了9.3%的二茬玉米作物，较前一周增长了4.6%，但仍低于去年同期的20.3%。预计巴西今年的二茬玉米产量将达到9790万吨，总产量将达到1.274亿吨。

14. 美国农业部数据显示，截至2023年6月22日当周，美国大豆出口检验量为141158吨，前一周修正后为179548吨，初值为185184吨。2022年6月23日当周，美国大豆出口检验量为476951吨。美国对中国（大陆地区）装运6172吨大豆。前一周美国对中国大陆装运5411吨大豆。当周美国对华大豆出口检验量占到该周出口检验总量的4.37%，上周是2.92%。



15. 美国农业部（USDA）周二凌晨公布的每周作物生长报告显示，截至 6 月 25 日当周，美国大豆优良率为 51%，市场预期为 51%，此前一周为 54%，去年同期为 65%。美国玉米生长优良率为 50%，市场预期为 52%，去年同期为 67%，此前一周为 55%。

金融市场

➤ 金融

1、国家发改委财金司组织召开扩大制造业中长期贷款投放现场会，要求加力推动扩大制造业中长期贷款投放工作常态化、机制化，扎实推动金融支持制造业发展提质增效。

2、国家金融监督管理总局印发《企业集团财务公司监管评级办法》。财务公司监管评级结果分为 1-5 级和 S 级，正处于重组、被接管、实施市场退出等情况的财务公司经监管机构认定后直接列为 S 级，不参加当年监管评级。

3、香港金融管理局发出检讨银行三级制的公众谘询文件，建议将三级制简化为二级制。银行三级制（即分为持牌银行、有限制牌照银行及接受存款公司）推出至今已有 40 年，目的是在维持进入银行体系灵活度与保障小存户之间取得平衡。

4、农业银行表示，截至 5 月末，农行制造业贷款余额突破 2.8 万亿元，贷款增量是去年同期增量 1.5 倍；其中，制造业中长期贷款较年初增长 38%。

5、据经济参考报，公募基金半年考交卷在即。Wind 数据显示，截至目前，全市场共 4069 只主动权益类基金年内收益告负，超过所有主动权益类基金总数的一半。其中，部分基金“押注式”投资致使业绩严重分化，引发了市场的关注和热议。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货投资咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



6、近期理财市场波动加大，部分产品一度净值回落。专家认为，此次债市调整仅为短期市场变化，调整空间有限，不具备引发银行理财大幅亏损的基础。与此同时，多家理财公司宣布调降部分理财产品费率，有些将固定管理费率下调至0。

7、大额存单在储户中再度走俏，3年期大额存单更是“一单难求”。业内人士认为，虽然各银行不断压降大额存单利率，但由于目前市场对未来存款利率下行形成较强预期，客户仍倾向于配置中长期定期存款和大额存单以锁定收益。

8、中基协发布数据显示，5月企业资产证券化产品新增备案规模1073.70亿元，环比增长52.78%，同比增长77.76%。截至5月末，存续企业资产证券化产品规模19758.42亿元，环比增长0.62%。

9、又有重磅央企ETF获批。第三批中证国新央企系列指数公募产品已获准发行，此次获批产品由嘉实、工银瑞信、博时基金申报，跟踪标的均为“中证国新央企现代能源指数”。

10、中信建投国家电投新能源REIT回应“西门子风机事件”称，基础设施项目所安装风电机组与目前市场信息所述陆上机组不同。截至目前，基金运作正常，市场传闻预计不会对基金及基础设施项目正常运营产生重大影响。

11、中国保险行业协会发布《发电企业保险风险评估工作指引》，对燃煤发电、水力发电、光伏发电、海上风电和海上风电等主要发电类型企业实现全覆盖的保险风险评估工作实务。

12、据中国证券报，复利3.5%增额终身寿险产品或将于6月30日全面停售，被复利3%的同类型产品取代。

13、上海市地方金融监管局局长周小全率队赴蚂蚁科技集团调研。周小全表示，目前上海市正加快推进区块链创新研发和深化应用，希望蚂蚁科技集团发挥技术优势，主动参与，积极贡献力量。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货投资咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



14、《重庆市银行机构绿色融资业绩评价办法（试行）》提出，绿色融资业绩评价体系由定性指标和定量指标构成，在权重上拟设定定量指标占 70%、定性指标占 30%。

➤ 楼市

1、易居房地产研究院发布报告显示，全国 20 个重点城市首套房首付比例平均值为 24%。其中，北京和上海首套房首付比例最高，为 35%。一些弱二线城市和绝大多数三四线城市都已执行 20%的首付比例政策。

2、上海首例房地产项目全程网办“交地即交证”落地。上海弘澳置业有限公司与普陀区规划和自然资源局相关部门签订土地交付确认书，当场领取建设用地规划许可证和不动产权证书。

3、苏州第三批次中两宗触顶住宅用地摇号结果出炉。万科和杭州大家实业集团分别摇号竞得姑苏区以及工业园区地块，溢价率分别为 15.08%、15.11%。

➤ 产业

1、自然资源部修订发布《工业项目建设用地控制指标》，对工业项目（或单项工程）及其配套工程在土地利用上进行指标控制，以加强工业项目建设用地管理，提升工业用地单位面积利用效率和产出水平。

2、国家体育总局等十二部门印发《关于推进体育助力乡村振兴工作的指导意见》，要求加强乡村全民健身公共服务体系建设，提升乡村公共服务水平；大力发展战略性新兴产业，助力乡村产业振兴。

3、农业农村部、自然资源部联合通报 5 起“大棚房”问题典型案例，要求各地加强设施农业管理，共同监督设施农业用地上相关设施建设使用，及时纠正制止、严肃查处各种违法违规占用耕地建设非农设施的行为。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货投资咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



4、华为开发者大会 2023（Cloud）大会将于 7 月 7 日开幕，华为云盘古大模型将迎来重大升级。从演讲主题来看，盘古大模型将首次明确定位，即“为行业而生”；盘古基础大模型全栈创新和行业大模型“炼成术”也将首次对外公布。

5、中国信通院发布数据显示，5 月国内市场手机出货量 2603.7 万部，同比增长 25.2%。其中，5G 手机 2016.9 万部，增长 13.7%，占同期手机出货量的 77.5%。

6、近日内蒙古包头地区高耗能企业被限电一周，当地光伏硅片拉晶企业受到影响。业内人士表示，当地确实有限电情形出现，但对整体拉晶产出影响不大。

7、杭州市发布新规，对网约车“提高要求”。申请用于网约车车辆须为新出厂新能源纯电动汽车，如果是非新能源纯电动汽车，车辆购置计税价格须在 15 万元以上。

➤ 海外

1、美联储理事鲍曼表示，美国银行业需要更好的监管，而不是更高的资本金要求，因为后者可能会阻碍放贷和竞争。鲍曼再次呼吁对银行倒闭事件进行独立调查。

2、德国央行发布月度报告称，德国经济已经触底反弹，预计第二季度 GDP 将略有增长。报告指出，未来几个月德国通胀率将进一步放缓，物价压力仍将非常高。

3、日本央行审议委员会意见摘要：必须保持宽松政策，但须注意可能低估日本物价上涨可持续性；由于收益率曲线形状扭曲问题已得到解决，无需对收益率曲线控制（YCC）进行操作调整。

4、英国 6 月 CBI 零售销售差值为 -9，预期 -8，前值 -10。

➤ 国际股市

1、热门中概股涨跌不一，盛丰物流涨 33.2%，硕迪生物涨 18.35%，好未来涨 5.72%，有道涨 4.55%，名创优品涨 3.69%，叮咚买菜涨 3.64%；跌幅方面，优品车跌 14.99%，能链智电跌 8.82%，比特数字跌 7.82%，尚乘数科跌 5.68%，360数科跌 4.11%。中概新能源汽车股涨跌互现，蔚来汽车跌 0.3%，小鹏汽车涨 2.93%，理想汽车涨 1.99%。

2、苹果公司产品发布路线图显示，今年秋季苹果将发布三款苹果手表，其中包括两款苹果手表 9 系列和第二代苹果手表 Ultra。

3、IBM 宣布，与 Vista Equity Partners 达成最终协议，将以 46 亿美元收购软件公司 Apptio，交易以现金方式支付。

4、消息称，Meta 计划在 7 月中旬推出一个全新的大型社交平台，正式名称或为 Threads。

5、德意志银行发现，支持俄罗斯存托凭证的基础股票出现短缺，已通知客户无法保证能够完全获得其持有的俄罗斯股票。

6、巴黎航展落幕，空客斩获订单远超波音。据统计，此次巴黎航展，得益于印度地区几家航司大额订单，空客斩获订单近 850 架，波音订单超过 350 架。

7、云数据库软件公司 Snowflake 宣布，扩大与微软合作伙伴关系，将大规模生成人工智能模型和增强机器学习功能引入数据云。

8、特斯拉墨西哥新莱昂州工厂最新计划建成投产时间为 2025 年一季度，比市场预计的晚 1-2 个季度。



9、通用汽车和澳大利亚矿产勘探和采矿公司 Element 25 达成协议，由 Element 25 每年供应多至 3.25 万公吨硫酸锰，以支持北美地区超过 100 万辆通用汽车电动汽车年产量。

10、英国豪华跑车制造商阿斯顿马丁表示，将与美国电动汽车初创公司 Lucid Group 签订战略供应协议，生产“高性能”电动汽车。

11、马自达开始量产使用转子发动机作为发电机的插电式混合动力车“MX-30”，为其 11 年来再次量产配备转子发动机的车型。

➤ 债券

1、债市综述，银行间主要利率债收益率多数上行，个别短券表现稍好。国债期货震荡略强，30 年期主力合约涨 0.21%，10 年期主力合约涨 0.04%。逆回购继续放量驰援半年末资金面，银行间资金宽松，隔夜回购加权利率续降逾 22bp 至 1.2%下方；非银跨月资金价格升至 3%附近。地产债涨跌不一，“20 益田优”涨超 20%，“21 碧地 01”跌超 14%。

2、据经济参考报，今年以来，仍有不少上市公司纷纷发行可转债，但从总体发行规模和交投活跃度来看，相较于之前的火热和盲目，今年可转债发行及投资渐趋理性。Wind 数据显示，截至 6 月 26 日，年内共有 57 只可转债上市发行，发行规模合计为 712.59 亿元，较去年同期下降 34.60%，可转债交投活跃度也不及去年同期。

3、可转债无退市纪录将被打破，风险事件备受市场关注。多家公司近期发布公告提示相关风险后，可转债价格出现大跌。帝欧转债、维尔转债等多只债券跌超 1%，且已跌破面值；中装转 2 近 7 个交易日跌超 13%。

4、央行在香港招标发行 6 个月期 50 亿元人民币央票，中标利率 2.24%。



5、北京、浙江、江苏等多地公开第三季度政府债券发行计划，三季度发债规模将超1万亿元，不少地方将在9月底前完成全年新增债券发行任务。

6、债券重大事件，因融创无法提供评级所需资料，中诚信国际终止其5笔债券信用评级；证监会对洛娃集团胡克勤和赵静文采取证券市场禁入措施；“20融侨01”6月29日起采用全价方式转让；债务重组尚在推进，“15华夏05”等6笔公司债继续停牌；“20渝隆资产MTN001”拟提前兑付。

➤ 外汇

1、周一在岸人民币兑美元16:30收盘报7.2219，较上一交易日下跌281个基点，夜盘收报7.2425。人民币兑美元中间价报7.2056，调贬261个基点。

2、外汇交易中心公布数据显示，上周三大人民币汇率指数全线下跌，CFETS人民币汇率指数为96.49，周跌0.27；BIS货币篮子人民币汇率指数报100.80，周跌0.35；SDR货币篮子人民币汇率指数报92.49，周跌0.49。

3、数字人民币正加速落地。上清所大宗商品现货清算业务6月26日上线数字人民币清结算服务并调整运营时间，数币清结算服务暂不收费。

4、日本内阁官房长官松野博一表示，将继续密切关注外汇波动情况，适当处理过度的货币波动。日本财务省副大臣神田真人指出，外汇应该稳定地反映基本面，如果外汇波动过于剧烈，将会做出应对，不排除做出任何选择。

5、土耳其里拉兑美元汇率持续刷新历史新低，自今年初以来，里拉已贬值超27%，其中仅在6月份就贬值超19%。



财经日历

经济数据

北京时间	指标
7:01	英国6月BRC商店物价指数
13:00	日本4月同步指标、领先指标终值
14:00	英国6月Nationwide房价指数
16:30	中国香港5月贸易帐
20:30	美国5月耐用品订单
20:55	美国上周红皮书商业零售销售
21:00	美国4月FHFA房价指数
22:00	美国5月新屋销售
22:00	美国6月谘商会消费者信心指数
22:00	美国6月里奇蒙德联储制造业指数

财经大事

北京时间	事件
	第十四届夏季达沃斯论坛举行
	欧洲央行中央银行论坛举行
9:20	央行公开市场有1820亿元逆回购到期
16:00	欧洲央行行长拉加德发表讲话
16:15	英国央行委员丁格拉发表讲话
16:30	英国央行委员滕雷罗参加央行论坛
16:30	欧洲央行中央银行论坛小组讨论
	维珍银河或进行首次商业太空飞行

数据来源：Wind

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货投资咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。



注：本文资讯内容根据网络，冠通期货编辑整理而成，仅供投资者参考。

分析师：

王静，执业资格证号 F0235424/Z0000771。

本报告发布机构：

—冠通期货股份有限公司（已获中国证监会许可的期货投资咨询业务资格）

免责声明：

本报告中的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。报告中的内容和意见仅供参考，并不构成对所述品种买卖的出价或征价。我公司及其雇员对使用本报告及其内容所引发的任何直接或间接损失概不负责。本报告仅向特定客户传送，版权归冠通期货所有。未经我公司书面许可，任何机构和个人均不得以任何形式翻版，复制，引用或转载。如引用、转载、刊发，须注明出处为冠通期货股份有限公司。

投资有风险，入市需谨慎。

本公司具备期货投资咨询业务资格，请务必阅读最后一页免责声明。