



资讯早间报

冠通研究 2022/8/2

市场走势

国内期货主力合约多数下跌。燃料油跌4%，低硫燃料油（LU）跌近4%，菜粕、棉花跌近3%，苯乙烯（EB）、豆二、棕榈油、液化石油气（LPG）跌超2%。

国际期货主力合约涨跌不一。CBOT大豆跌4.02%，CBOT玉米跌1.45%，CBOT豆油跌3.94%，CBOT豆粕跌4.16%，CBOT小麦跌0.99%。LME金属多数上涨，伦铜跌1.48%，伦铝跌1.55%，伦锌涨1.78%，伦铅涨1.25%，伦镍涨3.14%。

重要资讯

【宏观资讯】

➤ 外交部正告美方中方正严阵以待

中国外交部发言人赵立坚在8月1日的例行记者会上表示，中方近来已经多次向美方表明坚决反对佩洛西众议长赴台的严重关切和严正立场，强调佩洛西如赴台将导致严重后果。赵立坚强调，我们要再次正告美方，中方正严阵以待，中国人民解放军绝不会坐视不管。中方必将采取坚决应对和有力反制措施，捍卫自身主权和领土完整，美方应该做的是恪守一个中国原则和中美三个联合公报规定，兑现拜登总统不支持“台独”的承诺，不得安排佩洛西访台。

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。



➤ 央行召开 2022 年下半年工作会议：保持货币信贷平稳适度增长

人民银行召开 2022 年下半年工作会议，会议要求，保持货币信贷平稳适度增长。综合运用多种货币政策工具，保持流动性合理充裕。引导金融机构增加对实体经济的贷款投放，保持贷款持续平稳增长。引导实际贷款利率稳中有降。保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。用好政策性开发性金融工具，重点发力支持基础设施领域建设。加大金融支持民营小微企业等重点领域力度。

➤ 央行部署下半年重点工作 要求因城施策实施好差别化住房信贷政策

央行召开 2022 年下半年工作会议，会议要求，稳妥化解重点领域风险。防范化解中小银行风险。因城施策实施好差别化住房信贷政策。保持房地产信贷、债券等融资渠道稳定，加快探索房地产新发展模式。督促平台企业全面完成整改，实施规范、透明、可预期的常态化监管，发挥好平台经济创造就业和促进消费的作用。

➤ 广州：丰富商品期货品种，推动在岸与离岸、期货与现货联动发展

广州市商务局发布关于印发广州市促进综合保税区高质量发展实施意见的通知，其中提到，推进期货保税交割业务。把握广州期货交易所建设契机，完善期货保税交割监管政策，培育和发展农产品、化工、有色金属等大宗商品期货保税交割业务，丰富商品期货品种，推动在岸与离岸、期货与现货联动发展。

➤ 7 月财新中国制造业 PMI 降至 50.4，扩张速度放缓

财新智库高级经济学家王喆评中国 7 月财新制造业 PMI：7 月疫情形势向好和管控措施放松，助力制造业景气度持续恢复，但恢复基础尚不牢固。供给和需求持续改善，供强需弱格局维持；就业市场反馈有所迟滞，仍处于收缩区间；成本端稳中有升，收费端继续下降，企业盈利面临挑战；市场乐观情绪维持，但对经济前景亦有担忧。

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。



➤ 三部门：确保工业领域二氧化碳排放在 2030 年前达峰

工业和信息化部、国家发展改革委、生态环境部三部门：“十五五”期间，产业结构布局进一步优化，工业能耗强度、二氧化碳排放强度持续下降，努力达峰削峰，在实现工业领域碳达峰的基础上强化碳中和能力，基本建立以高效、绿色、循环、低碳为重要特征的现代工业体系。确保工业领域二氧化碳排放在 2030 年前达峰。

【黑色系期货】

➤ 中国 45 港铁矿石到港总量 2165.3 万吨，环比增加 114.5 万吨

据 Mysteel，7 月 25 日—7 月 31 日中国 47 港到港总量 2285.7 万吨，环比增加 187.9 万吨；中国 45 港到港总量 2165.3 万吨，环比增加 114.5 万吨；北方六港到港总量为 1154.6 万吨，环比增加 218.5 万吨。

➤ 澳洲巴西 19 港铁矿发运总量 2653.5 万吨，环比增加 133.8 万吨

7 月 25 日-7 月 31 日 Mysteel 澳洲巴西 19 港铁矿发运总量 2653.5 万吨，环比增加 133.8 万吨。澳洲发运量 1750.6 万吨，环比减少 153.2 万吨，其中澳洲发往中国的量 1530.9 万吨，环比减少 132.2 万吨。巴西发运量 902.9 万吨，环比增加 287.0 万吨。全球铁矿石发运总量 3233.8 万吨，环比增加 193.7 万吨。

➤ 三部门：制定钢铁、建材、石化化工、有色金属等行业碳达峰实施方案

工业和信息化部、国家发展改革委、生态环境部三部门：聚焦重点行业，制定钢铁、建材、石化化工、有色金属等行业碳达峰实施方案。①严格落实钢铁产能置换和项目备案、环境影响评价、节能评估审查等相关规定，切实控制钢铁产能。②严格执行水泥、平板玻璃产能置换政策，依法依规淘汰落后产能。③增强天然气、乙烷、丙烷等原料供应能力，提高低碳原料比重。合理控制煤制油气产能规

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。



模。④坚持电解铝产能总量约束，研究差异化电解铝减量置换政策，防范铜、铅、锌、氧化铝等冶炼产能盲目扩张，新建及改扩建冶炼项目须符合行业规范条件，且达到能耗限额标准先进值。

【农产品期货】

➤ 全国重点地区棕榈油商业库存约 22.99 万吨，较上周减少 4.22 万吨

据 Mysteel，截至 2022 年 7 月 29 日（第 30 周），全国重点地区豆油商业库存约 88.99 万吨，较上周减少 0.13 万吨，减幅 0.15%。全国重点地区棕榈油商业库存约 22.99 万吨，较上周减少 4.22 万吨，减幅 15.51%；同比 2021 年第 30 周棕榈油商业库存减少 15.09 万吨，降幅 39.63%。

➤ 全国主要油厂大豆实际压榨量为 174.31 万吨，开机率为 60.59%

据 Mysteel 对国内主要油厂调查数据显示：2022 年第 30 周，全国主要油厂大豆库存上升，豆粕库存及未执行合同均下降。开机情况：第 30 周（7 月 23 日至 7 月 29 日）全国主要油厂大豆实际压榨量为 174.31 万吨，开机率为 60.59%。成交情况：第 30 周共成交 60.26 万吨，日均成交 12.05 万吨，成交均价 4165 元/吨。

➤ 全国进口大豆港口库存环比增加 2.41 万吨

据 Wind 数据，截至 8 月 1 日，全国进口大豆港口库存为 691.34 万吨，7 月 25 日为 688.93 万吨，环比增加 2.41 万吨。

➤ 马来政府正在与行业人士就降低棕榈油价格进行谈判

据外媒报道，马来西亚政府正在与棕榈油行业的参与者进行谈判，以设计出最佳方案，加快降低供应价格。国内贸易和消费者事务部秘书长 Datuk Azman Mohd

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。



Yusof 称，棕榈油的价格取决于全球市场。“我们正在与行业谈判，以确定一种能更快降低（棕榈油价格）的方式，但必须是合理的，因他们也希望确保运营成本不会受到影响。”

➤ 美国农业部：上周美国对中国装运大豆大幅增加！

截至 2022 年 7 月 28 日当周，美国大豆出口检验量为 555083 吨，前一周修正后为 392480 吨，初值为 388212 吨。2021 年 7 月 29 日当周，美国大豆出口检验量为 185723 吨。本作物年度迄今，美国大豆出口检验量累计为 53561468 吨，上一年度同期 58357567 吨。美国对中国（大陆地区）装运 130733 吨大豆。前一周美国对中国大陆装运 6856 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 23.55%，上周是 1.77%。

【能化期货】

➤ 油轮跟踪数据：沙特 7 月原油出口升至两年多新高

在国际社会抑制油价上涨的压力下，沙特 7 月原油出口量飙升至 2020 年 4 月以来的最高水平。据机构收集的油轮跟踪数据显示，上个月沙特海上运输量达到 750 万桶/日左右，6 月修正后数据为 660 万桶/日。沙特官员尚未对此置评。据报道，上个月，对印度的出口量自 2020 年 4 月以来首次超过 100 万桶/日。初步数据显示，7 月份沙特对美国的原油日出口量从上月的 41.7 万桶降至约 37.1 万桶，对日本的石油出口量下降约 18%，至 90.3 万桶/日。

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。



【金属期货】

➤ 印尼将在第三季度发布镍出口税收规则

据外媒报道，印尼高级官员表示，印尼计划在今年第三季度发布镍出口税收政策，寻求增加出口收入，同时鼓励国内生产更多更高附加值的产品。该政策将对镍生铁和镍铁征税，但尚未有税率细节。

➤ 七地锌锭库存总量为 13.83 万吨，较上周五（7 月 25 日）减少 4800 吨

据 SMM 了解，截至本周一（8 月 1 日），SMM 七地锌锭库存总量为 13.83 万吨，较上周五（7 月 25 日）减少 4800 吨，较上周五（7 月 29 日）增加 1400 吨，国内库存小幅录增。其中上海市场，由于锌价近期上涨幅度较大，下游多观望为主，市场成交走弱，上海库存基本维持不变；广东市场，本周锌价高位，叠加压铸企业进入淡季消费，接货力度明显走弱，本周随着到货增加，广东地区小幅累库。

➤ SMM：铜库存进入极底区域 美元持续下行 铜价持续反弹

近一个月，沪铜连续滑落，并于 7 月 15 日刷新 2020 年 11 月 19 日以来新低至 53400 元/吨。随后开启一波反弹之势，近期走出七连涨，今日盘中一度涨 2.53%，截至日间收盘，涨幅收窄至 1.96%。整体看，宏观利空稍有缓解，美元持续下行以及国内现货紧张是铜价反弹的重要驱动。在 9 月份的议息会议以及 20 大前，处于政策真空期，铜价在基本面支撑下仍有一定反弹空间。

➤ 低库存支撑沪镍一度涨近 9%，消费疲软拖累价格

据 SMM 分析，截止 8 月 1 日，供给端，上周纯镍现货升水维持下调趋势，海外纯镍进口比值扩大，但受需求减弱影响清关情况不及预期。镍铁方面，印尼镍铁不断回流挤占市场，同时 FENI 供应也较为宽松，货物积压价格较低。国内铁厂在劣势的成本竞争压力下，面临亏损，挺价意愿较强。需求端，不锈钢厂亏损主动

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。



减产，内需消费疲弱，整体供需表现双弱。合金方面，虽现货价格目前较高，需求有所减弱。综上，虽目前受镍价高企影响需求小幅减弱，但目前低库存或给予镍价一定支撑。

金融市场

➤ 金融

1、全国专项办召开全国打击整治养老诈骗专项行动第2次推进会，要求加快分类处置，整治一批养老领域经营不规范、存在诈骗苗头隐患的机构、企业。尽快摸清无证无照黑养老机构底数，集中开展联合执法整治，坚决攻下“黑机构”堡垒。

2、又一波试点机构养老理财产品即将上线！8月3日（本周三），中邮理财旗下第一期养老理财产品将在10个试点地区发售。相比第一批试点机构产品，中邮理财此次发行的养老理财产品普惠性更为突出，仅1分钱起售。此外，农银理财、信银理财等其他第二批试点机构首期养老理财产品也有望于近期发行。

3、中基协公布二季度非货币公募基金月均规模，易方达以月均10488.11亿元遥遥领先，华夏基金、广发基金、富国基金分列第二至第四位，规模分别为6840.17亿元、6322.94亿元和6102.99亿元。券商私募资管方面，中信证券以月均11792.51亿元位列榜首，中银证券、中金公司分列第二、第三位，规模分别为6551.91亿元和5470.43亿元。

4、中信证券公告，控股子公司华夏基金上半年实现营业收入36.33亿元，净利润10.58亿元，综合收益总额10.99亿元。截至6月30日，华夏基金总资产157.07亿元，总负债44.66亿元，华夏基金母公司管理资产规模为17401.72亿元。

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。



5、据经济参考报，Wind 数据显示，截至目前，全市场 322 只 FOF 基金总规模达 2262.17 亿元，较年初增长 39.76 亿元。受市场表现影响，FOF 产品的业绩收益也企稳回升。近三个月，在整体取得正收益的同时，共有 50 只产品总回报超 10%。

6、据中国基金报，中基协公布二季度各项资管业务月均规模数据。TOP20 券商私募资产管理月均规模合计达到 5.66 万亿元，环比下滑约 4%。TOP20 榜单中，共有 11 家券商二季度私募资产管理月均规模环比减少（未含新晋公司）。针对二季度券商私募资管规模环比缩水的原因，有市场人士表示，主要是受市场行情及渠道、投资者信心等多方面影响。也不排除部分机构存在“踩空”行情的情况。

➤ 楼市

1、中指研究院发布《百城价格指数报告》显示，7 月份，全国 100 个城市新建住宅价格环比止涨转跌，跌幅为 0.01%；二手住宅价格仍环比下跌 0.09%，跌幅较上月扩大 0.07 个百分点。7 月百城新房、二手房价格环比下跌的城市数量均有增加。其中新房环比下跌城市数量由前一个月 41 个增至 47 个；二手房价格环比下跌城市数量由前一个月 58 个增至 69 个。

2、据中指研究院测算，7 月份，受到多地进行第二轮集中供地的带动，300 城土地出让收入达 4072 亿元，同比增长 46.71%。1-7 月份，全国 300 城土地成交规划建筑面积 8.4 亿平方米，同比下降 23.2%，各类用地出让金达 18782.38 亿元，同比下降 42.31%。

3、杭州出台三孩家庭公积金优惠政策：购买首套普通自住住房且首次申请公积金贷款贷款的，贷款额度上浮 20%；无房租赁住房提取住房公积金的，提取限额上浮 50%。

4、河北沧州市出台优惠政策，提高多孩家庭住房公积金贷款额度。其中，二孩家庭最高贷款额度上浮 10 万元，三孩家庭最高贷款额度上浮 20 万元。

5、天津市年内第二批集中土地出让收官。本批次集中供地共推出 11 宗涉宅用地，成交 9 宗地块，且均底价成交，共计总成交额 82.009 亿元。

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。



➤ 产业

1、国家药监局药审中心回应新冠新药研发问题称，目前有鼻、咽喷雾剂等给药途径药物申报拟用于新冠肺炎的治疗或预防，对于此类情形，结合专家意见认为，该给药途径用于抗病毒治疗和预防的研发应慎重。对于预防适应症可能有一定的临床价值。对此类品种，除体外药效学试验外，应采用动物体内药效学研究考察拟给药途径下的预防有效性。

2、最高检要求积极稳妥开展反垄断领域公益诉讼，重点针对法律明令禁止的垄断行为、涉及国计民生的重要领域、关系市场竞争规则的关键环节、严重侵害众多消费者权益的公益损害的突出问题，重点关注互联网、公共事业、医药等民生保障领域，精准开展反垄断公益诉讼检察工作。

3、市场监管总局正式上线经营者集中反垄断业务系统。该系统集合了我国经营者集中反垄断法律法规制度、申报流程、审查流程，实现“申报端”“委托端”和“审查端”数字化交互，通过数字赋能推动提升申报和审查效能。

4、市场监管总局（标准委）近日批准发布一批重要国家标准，涉及信息技术、旅游服务、绿色可持续、生活消费、汽车等领域。其中，《电动汽车充电系统信息安全技术要求及试验方法》国家标准，从充电系统的硬件安全、软件安全、数据安全、通信安全四个维度，提出信息安全技术要求及试验方案，推动提升我国电动汽车信息安全技术水平。

5、国家发改委等多部门印发通知，确定北京、天津、上海、广州等60个城市为废旧物资循环利用体系建设重点城市。

6、中国商飞官微宣布，国产大飞机C919完成取证试飞。

7、据国铁集团，7月份，全国铁路运输呈现客运继续回暖向好、货运持续高位运行良好态势，累计发送旅客2.24亿人次，日均722.8万人次；累计发送货物4.1亿吨，日均1322万吨。

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。



8、上海发布《外省市国五及以上排放标准小型非营运二手车转入办理指南》称，自8月1日起，外省市凡符合国五及以上排放标准的小型非营运二手车，可申请转入上海市。

9、Canalys 报告显示，今年第二季度，全球智能手机出货量减少至 92.87 亿台，为 2020 年第二季度后的季度最低点。三星出货量为 6180 万台，市场份额 21% 领跑。苹果出货量达到 4950 万台，市场份额 17% 稳居第二。小米出货量达到 3960 万台位列第三，OPPO 和 vivo 分别以 2730 万台和 2540 万台的出货量跻身市场前五。

10、Strategy Analytics 最新研究指出，受新冠疫情影响，2022 年第二季度中国智能手机出货量同比下降 14%，至 6770 万部。荣耀首次以 19% 的市场份额成为中国最大的智能手机厂商。vivo、OPPO(包括一加)、小米和苹果跻身前五。

11、中国汽车流通协会发布，7 月份二手车经理人指数为 46.3%，处于荣枯线以下，二手车市场仍处在不景气区间。

12、电池回收企业深圳市恒创睿能完成超 3 亿元 B 轮融资，资方包括君联资本、广发系资本、恒信华业、瀚晖资本等机构。

➤ 海外

1、明尼阿波利斯联储主席卡什卡利表示，市场对美联储将结束加息计划预期有些超前，美联储目前正团结一致，决心让通胀回到 2%，要做到这一点，美联储还有很长的路要走。

2、韩国央行向国会递交报告表示，只要 CPI 走势不与当前预期“脱锚”，以 0.25 个基点步伐逐步加息比较合理，并强调有必要通过持续加息抑制通胀。韩国央行预测今年 CPI 涨幅可能大幅超出 5 月预期（4.5%），经济增速则将略低于预期（2.7%）。

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。



3、摩根大通改变此前欧洲央行将在9月和10月分别加息25个基点的预期，现在认为欧洲央行将在9月再次加息50个基点，然后在10月暂停加息，因为到那时，欧元区经济可能会明显地走向全面收缩。

4、美国7月ISM制造业PMI为52.8，创2020年6月以来新低，预期52，前值53。其中，生产指标也跌至逾两年低点，新订单指标连续第二个月处于萎缩区域；库存指数则升至57.3，为1984年以来最高水平。另外，美国7月Markit制造业PMI终值为52.2，预期52.3，初值52.3。

5、欧元区7月制造业PMI终值49.8，预期49.6，初值49.6，6月终值52.1。德国7月制造业PMI终值49.3，预期49.2，初值49.2。法国7月制造业PMI终值49.5，预期49.6，初值49.6，6月终值51.4。

6、德国6月实际零售销售同比降8.8%，预期降8%，前值降3.6%；环比降1.6%，预期增0.2%，前值增0.6%。

7、韩国7月出口同比增加9.4%，但受能源价格飞涨影响，进口增加21.8%，增速远超出口，贸易收支连续第四个月出现逆差。

➤ 国际股市

1、热门中概股多数下跌，鑫苑置业跌33.15%，途牛跌23.46%，天境生物跌18.61%，优信跌16.17%，思享无限跌15.2%，叮咚买菜跌13.23%，每日优鲜跌13.12%，逸仙电商跌12.41%，丽翔教育跌10.38%，图森未来跌9.74%；涨幅方面，尚乘数科涨91.64%，金太阳教育涨13.14%，NANO LABS涨13.11%，36氪涨10.43%，脑再生涨8.48%，中北能涨7.22%；中概新能源汽车股集体上涨，蔚来汽车涨2.23%，小鹏汽车涨0.12%，理想汽车涨3.84%。

2、波音公司宣布将在日本新设研究与技术中心（BR&T），专注于可持续发展，并支持与日本经济产业省新近扩大与可持续航空燃料、电气、氢能等合作协议。

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。



3、对冲基金绿光资本创始人 David Einhorn 致信投资者称，该基金已入股推特，平均买入价格为 37.24 美元/股。马斯克此前提出每股 54.20 美元的价格收购推特，目前推特股价高于 40 美元。

4、苹果将分四部分发行价值 55 亿美元的债券。此次发行的最长期限债券为 40 年期，收益率将比美国国债高出 118 个基点。

5、每日优鲜否认发布“资金断链无法正常经营”通知。此前有消息称，每日优鲜发布公告称，资金断链，无法正常经营。与资金监管机构已经协商，为公司组织专项小组，启动资金账户，为广大供应商消费者，清退费用。

6、老虎证券相关负责人否认“裁员”传闻，表示目前公司正配合国际化战略，积极开拓海外业务，并搭建更具国际化视野以及海外本土化融合的团队。

7、韩国五家整车厂商 7 月全球销量为 66.53 万辆，时隔 5 个月实现同比增长，增幅为 6.9%。其中，现代汽车销量为 32.6 万辆，同比增长 4%；起亚销量同比增长 6.3%，为 25.79 万辆。

8、知情人士称，贝恩资本已开始为亚太地区筹集一个 50 亿美元基金。

9、英特尔计划到 2024 年在设备中引入下一代无线网络技术——WiFi7（802.11be）。英特尔预测，WiFi7 的应用将会扩大。它将通过高端游戏、增强现实（AR）、虚拟现实（VR）和机器人等先进技术扩大产品应用，加强对 WiFi 市场的渗透。

10、动视暴雪第二季度每股收益 0.36 美元，预期 0.52 美元。营收 16.44 美元，预期 15.84 美元。净利润 2.8 亿美元，预期 4 亿美元。动视暴雪美股盘后涨 0.25%。

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。



➤ 商品

1、国内商品期货夜盘收盘多数下跌，能源化工品表现疲软，燃油跌4%，苯乙烯跌2.68%，甲醇跌2.66%，乙二醇跌2.43%，LPG跌2.43%，橡胶跌2.17%。黑色系多数下跌，铁矿石跌1.13%，热卷跌0.69%。农产品普遍下跌，棉花跌2.99%，菜粕跌2.93%，棕榈油跌2.66%，豆二跌2.51%，豆粕跌2.06%，豆油跌2%。

2、中钢协召开常务理事会议，审议通过了关于成立铁矿石工作委员会的议案。委员会由大型重要钢铁企业及中国矿产资源集团有限公司组成，后续可视工作开展情况和需要增加成员。

3、据证券时报，在前期一度跌破20000元/吨关口后，国内生猪期货主力合约价格企稳反弹。8月1日，生猪2209合约收于20810元/吨，较7月中旬的阶段高点仍有10%以上的回落。不过分析机构多认为，短期供应端难有大幅放量背景下，国内生猪价格或仍维持震荡走强格局。

4、俄气在7月的天然气日产量为7.74亿立方米，较6月份下降14%，跌至至少2008年以来的最低水平，对关键市场的出口连续第四个月下降。俄气计划在2022年全年生产4944亿立方米天然气，较去年下降4%。

5、印尼高级官员表示，印尼将于第三季度发布镍出口税收规定，拟对镍、生铁、镍铁征收出口税。另外，印尼保留棕榈油的国内销售要求，但允许提高出口配额。

6、欧盟正式开始实施7月通过的自愿削减天然气用量协议。根据该协议，欧盟成员国将在今年8月1日至明年3月31日期间，通过各自选择的措施，将天然气需求在过去5年平均消费量基础上减少15%。

7、波罗的海干散货指数跌1.21%，报1872点，创2月9日以来最低水平。

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。



➤ 债券

1、资金宽松叠加 PMI 走弱，现券期货延续强势。银行间主要利率债收益率明显下行，短券表现更好收益率下行 5-6bp。国债期货全线收涨，10 年期主力合约涨 0.19%，创逾半年收盘新高；月初银行间资金面宽松，主要回购利率普降，隔夜回购加权利率下行逾 10bp 至 1.17%附近；地产债整体走弱多数下跌，“18 金地 07”跌超 18%，“20 世茂 G1”跌近 12%。

2、中证转债指数收盘涨 0.36%，成交额 994.37 亿元；万得可转债等权指数收盘涨 0.65%，成交额 1003.98 亿元；“永东转 2”涨 20%，蓝晓转债涨超 15%，中大转债涨超 11%，精达转债涨 9%，彤程转债涨近 7%；模塑转债和溢利转债均跌超 4%，太阳转债跌近 3%，天能转债跌近 2%。

3、据证券时报，8 月 1 日是可转债新规实施的第一天。Wind 数据显示，当天转债市场整体成交额约 1004 亿元，相比上一交易日缩水近 15%。当天全部 400 余只可转债中，仅有 106 只涨幅超过 1%，也仅有一只“永东转 2”达到了 20%的涨停板，同时多只转股溢价率和纯债溢价率双高的妖债继续领跌。分析观点认为，预计转债整体估值继续高位震荡，择券思路仍应坚持正股驱动。

4、龙光集团债务重组方案仍在起草中，将优先考虑离岸债务；“20 奥园 02”持有人会议审议通过利息展期兑付议案、8 月 8 日支付“20 奥园 02”本期利息的 10%；华南城延长票据到期日得到绝大多数票据持有人同意；“21 福建阳光 SCP003”触发偿债保障承诺条款；中诚信国际终止同济堂医药主体、相关债项及其担保方主体信用评级；穆迪授予远洋集团“Ba1”企业家族评级，展望调整为“负面”；华为拟发行 30 亿元超短融，募资用于补充营运资金；国厚资产收到银行间债券市场自律处分决定书；蓝光发展新增诉讼涉案金额合计 1.85 亿元；融信集团拟对“19 融信 01”、“19 融信 02”和“20 融信 01”启动撤销回售业务。

➤ 外汇

1、周一在岸人民币兑美元 16:30 收盘报 6.7549，较上一交易日跌 159 个基点。人民币兑美元中间价报 6.7467，调贬 30 个基点。交易员称，中国 PMI 数据疲软表明经济复苏仍面临阻力，短期人民币或震荡偏弱，波动性料逐渐收敛。

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。



2、上周三大人民币汇率指数普跌。外汇交易中心数据显示，7月29日，CFETS人民币汇率指数报102.62，按周跌0.07；BIS货币篮子人民币汇率指数报107.90，按周跌0.35；SDR货币篮子人民币汇率指数报100.78，按周跌0.11。

3、香港金管局买入62.45亿港元以捍卫联系汇率制度，使得最近24小时累计购买金额

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。



财经日历

经济数据

北京时间	指标
7:00	韩国7月CPI
9:30	澳大利亚6月季调营建许可
14:00	英国7月Nationwide房价指数
15:00	瑞士第三季度消费者信心指数
15:00	西班牙7月失业人数
15:30	瑞士7月SVME采购经理人指数
16:30	中国香港6月零售销售
20:00	加拿大至7月29日全国经济信心指数
21:30	加拿大7月RBC制造业采购经理人指数
22:00	美国6月JOLTs职位空缺

财经大事

北京时间	事件
10:00	国家卫健委介绍党的十八大以来中医药政策体系完善和服务能力提升有关情况
12:30	澳洲联储利率决议
22:00	2023年FOMC票委、芝加哥联储主席埃文斯主持媒体早餐会，讨论美国经济和货币政策

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。

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。