



资讯早间报

冠通研究 2022/8/16

市场走势

国内期货主力合约夜盘多数下跌菜油跌近5%，苯乙烯（EB）、低硫燃料油（LU）、PTA跌超3%，沪镍跌近3%。涨幅方面，棉花涨超2%。

国际期货主力合约多数下跌。CBOT农产品方面，CBOT大豆跌3.03%，CBOT玉米跌2.34%，CBOT豆油跌1.46%，CBOT豆粕跌3.04%，CBOT小麦跌0.87%。LME金属方面，伦锌涨0.22%，伦铅跌0.41%，伦镍跌4.87%，伦铝跌1.27%，伦铜跌1.4%。

重要资讯

【宏观资讯】

➤ 国防部新闻发言人吴谦就美国国会议员窜访台湾发表谈话

中国人民解放军东部战区在台岛周边海空域组织多军兵种联合战备警巡和实战化演练，就是对美台勾连挑衅的坚决回击和严正震慑。中国人民解放军持续练兵备战，坚决捍卫国家主权和领土完整，坚决粉碎任何形式的“台独”分裂和外来干涉图谋。

➤ 国家统计局：房地产市场当前整体上处于筑底阶段

国家统计局新闻发言人付凌晖表示，今年以来，各地坚持房住不炒，因城施策，支持刚性和改善性合理住房需求，出台多项稳定房地产市场政策，房地产市场总体下行态势趋缓。总的看，房地产市场呈现下行态势，当前整体上处于筑底阶段。

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。



随着房地产市场长效机制不断完善，因城施策效果逐步显现，房地产市场有望逐步企稳，保持平稳健康发展，对于经济的影响会逐步改善。

➤ 央行开展 4000 亿元 1 年期 MLF 操作，利率下调 10 个基点

央行公开市场开展 4000 亿元 1 年期 MLF 操作和 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率分别报 2.75%、2.0%，上次分别为 2.85%、2.10%。8 月有 6000 亿元 MLF 到期。

➤ 国家统计局：7 月份国民经济延续恢复态势

国家统计局：7 月份，面对国际环境更趋复杂严峻和国内疫情散发多发的不利局面，各地区各部门坚持稳中求进工作总基调，高效统筹疫情防控和经济社会发展，有力实施稳经济一揽子政策措施，生产供给继续恢复，就业物价总体平稳，对外贸易增势良好，民生保障有力有效，经济延续恢复态势。

➤ 国家统计局：个别月份居民消费价格涨幅可能会较高

国家统计局新闻发言人付凌晖表示，我国经济整体上处于恢复过程中，市场需求拉动价格上涨动力并不强，加之我国没有采取“大水漫灌”财政货币政策，价格大幅上涨缺乏相应货币条件。从下半年看，尽管受短期因素影响，个别月份居民消费价格涨幅可能会较高，但是从全年来看，居民消费价格保持在合理水平是有条件的。

➤ 莱茵河关键航段处于无法通航状态

据市场消息称，莱茵河关键航段——考布河段的水位已下降到 30 厘米，彭博数据显示，莱茵河关键航段处于无法通航状态。德国联邦水道与航运管理局 15 日宣布，在北莱茵-威斯特法伦州的艾默里奇地区，莱茵河的水位已下降至 4 厘米，

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。



此前的历史最低纪录为 2018 年秋季测量到的 7 厘米，根据该管理局的预测，该地区的水位可能最早在 16 日降低至零。

【黑色系期货】

➤ 7 月份一线城市商品住宅销售价格环比微涨，二三线城市环比整体呈降势

国家统计局数据显示，7 月份，70 个大中城市中商品住宅销售价格下降城市个数略增。一线城市商品住宅销售价格环比微涨、同比涨幅回落，二三线城市环比整体呈降势、同比降幅扩大。7 月份，70 个大中城市中，新建商品住宅和二手住宅销售价格环比下降城市分别有 40 个和 51 个，比上月分别增加 2 个和 3 个。

➤ 国家统计局：1-7 月份全国房地产开发投资下降 6.4%

国家统计局数据显示，1-7 月份，全国房地产开发投资 79462 亿元，同比下降 6.4%，1-7 月份，房地产开发企业房屋施工面积 859194 万平方米，同比下降 3.7%。房屋新开工面积 76067 万平方米，下降 36.1%。房屋竣工面积 32028 万平方米，下降 23.3%。

➤ 中钢协：2022 年 8 月上旬重点统计钢铁企业产存情况

2022 年 8 月上旬，重点统计钢铁企业共生产粗钢 1943.31 万吨、生铁 1789.97 万吨、钢材 1942.56 万吨。其中粗钢日产 194.33 万吨，环比增长 2.81%；生铁日产 179.00 万吨，环比增长 2.01%；钢材日产 194.26 万吨，环比增长 2.89%。

➤ 中国 45 港铁矿石到港总量 2113.2 万吨，环比减少 307.5 万吨

8 月 8 日-8 月 14 日中国 47 港铁矿石到港总量 2274.7 万吨，环比减少 221.5 万吨；中国 45 港铁矿石到港总量 2113.2 万吨，环比减少 307.5 万吨；北方六港铁矿石到港总量为 1215.6 万吨，环比减少 301.3 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。



➤ **澳洲巴西 19 港铁矿发运总量 2397.9 万吨，环比减少 213.5 万吨**

8月8日-8月14日 Mysteel 澳洲巴西 19 港铁矿发运总量 2397.9 万吨，环比减少 213.5 万吨。澳洲发运量 1761.5 万吨，环比减少 144.3 万吨，其中澳洲发往中国的量 1550.8 万吨，环比减少 17.7 万吨。巴西发运量 636.4 万吨，环比减少 69.2 万吨。全球铁矿石发运总量 2849.1 万吨，环比减少 272.9 万吨。

➤ **山西下发通知预防暴雨洪涝灾害引发煤矿事故灾难**

山西省应急管理厅和山西省地方煤矿安全监督管理局联合下发了《关于进一步强化暴雨期间煤矿安全工作的紧急通知》。山西各级煤矿安全监管部門、各煤矿企业要強化预警预报、防洪调度、巡查排险、转移避险等重点工作，做足重要设施安全防护、应急预案完善演练、抢险力量预置调配等应急准备；同时，各级煤矿安全监管部門要加强对汛期煤矿安全违法违规行为的监督检查。

【农产品期货】

➤ **美国农业部：美国大豆出口检验量为 744571 吨，美国玉米出口检验量为 538406 吨**

美国农业部数据显示，截至 2022 年 8 月 11 日当周，美国大豆出口检验量为 744571 吨，出口检验量累计为 55283872 吨。美国玉米出口检验量为 538406 吨，出口检验量累计为 53079695 吨。美国小麦出口检验量为 373227 吨，出口检验量累计为 3882869 吨。

➤ **美国农业部：上周美国对中国大陆装运 280936 吨大豆，对中国大陆的玉米出口检验量为 273383 吨**

美国农业部发布的出口检验周报显示，截至 2022 年 8 月 11 日当周，美国对中国（大陆地区）装运 280936 吨大豆。当周美国对华大豆出口检验量占到该周出口

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。



检验总量的 37.73%。对中国大陆的玉米出口检验量为 273383 吨，当周美国对华玉米出口检验量占到该周出口检验总量的 50.78%。

➤ 乌克兰农业部：尽管港口畅通，乌克兰粮食出口仍下降近半

乌克兰农业部周一表示，到目前为止，乌克兰 2022/23 年度粮食出口同比下降 46%，为 265 万吨。乌克兰的粮食出口自从俄乌冲突开始以来就大幅下降，因乌克兰主要运输通道黑海港口被封锁。农业部数据显示，2022/23 年度迄今为止的出口包括 175 万吨玉米、65.8 万吨小麦和 22.6 万吨大麦。乌政府表示，今年可能收获至少 5000 万吨粮食，2021 年为创纪录的 8600 万吨。

➤ 巴西棉花产量预计将至多增长 19%

据外媒报道，巴西棉花产量应会较上一年度增长 13-19%，恢复到新冠肺炎疫情大流行前的速度，这对巴西和全球来说都是一个令人鼓舞的消息。巴西棉花产量在五年内就翻了一番，但疫情导致全球房屋需求下降，中断了该国的生产。2022 年棉花产量预计在 260-280 万吨之间。巴西棉花的品质同样吸引海外兴趣。主要是亚洲市场，那里也是最大的成衣行业集中地。

➤ 机构：8 月 1-15 日马棕油出口量较上月同期-1.92%至 2.8%

①据船运调查机构 ITS 数据显示，马来西亚 8 月 1-15 日棕榈油出口量为 533050 吨，较 7 月同期出口的 518520 吨增加 2.8%。

②据马来西亚独立检验机构 AmSpec 数据显示，马来西亚 8 月 1—15 日棕榈油出口量为 490375 吨，较 7 月 1—15 日出口的 499964 吨减少 1.92%。

➤ NOPA：美国 7 月大豆压榨量低于市场预期

美国油籽加工商协会（NOPA）：7 月豆油库存为 16.84 亿磅，市场预期为 17.13 亿磅，6 月份数据为 17.67 亿磅，2021 年 7 月数据为 16.17 亿磅。7 月大豆压榨

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。



量为 1.7022 亿蒲式，市场预期为 1.71525 亿蒲式耳，6 月份数据为 1.64677 亿蒲式，2021 年 7 月数据为 1.55105 亿蒲式耳。

➤ 美国农业部（USDA）作物生长报告

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 8 月 14 日当周，

①美国大豆生长优良率为 58%，市场预期为 58%，此前一周为 59%，去年同期为 57%；开花率为 93%，此前一周为 89%，去年同期为 94%，五年均值为 93%；结荚率为 74%，此前一周为 61%，去年同期为 80%，五年均值为 77%。

②美国玉米生长优良率为 57%，市场预期为 56%，此前一周为 58%，去年同期为 62%；吐丝率为 94%，此前一周为 90%，去年同期为 98%，五年均值为 97%；蜡熟率为 62%，此前一周为 45%，去年同期为 71%，五年均值为 65%。玉米凹陷率为 16%，此前一周为 6%，去年同期为 20%，五年均值为 20%。

③美国棉花优良率为 34%，此前一周为 31%，去年同期为 67%；结铃率为 80%，之前一周为 69%，去年同期为 73%，五年均值均为 78%。盛铃率为 15%，此前一周为 9%，去年同期为 9%，五年均值为 14%。

④美国春小麦生长优良率为 64%，市场预估为 63%，此前一周为 64%，去年同期为 11%；春小麦收割率为 16%，市场预估为 22%，此前一周为 9%，去年同期为 55%，五年均值为 35%。

⑤美国冬小麦收割率为 90%，市场预期均值为 92%，之前一周为 86%，上年同期为 97%，五年均值为 94%。

➤ 2022 年 8 月第 2 周，巴西商贸部农产品出口数据汇总

①累计装出大豆 307.08 万吨，去年 8 月为 648.42 万吨。日均装运量为 30.71 万吨/日，较去年 8 月的 29.47 万吨/日增加 4.19%；

②累计装出玉米 323.63 万吨，去年 8 月为 433.58 万吨。日均装运量为 32.36 万吨/日，较去年 8 月的 19.71 万吨/日增加 64.21%；

③累计装出未加工的棉花 1.82 万吨，去年 8 月为 5.08 万吨。日均装运量为 0.18 万吨/日，较去年 8 月的 0.23 万吨/日减少 21.05%；

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累计装出白糖 150.59 万吨，去年 8 月为 254.73 万吨。日均装运量为 15.06 万吨/日，较去年 8 月的 11.58 万吨/日增加 30.05%；

⑤累计装出豆粕 89.24 万吨，去年 8 月为 160.23 万吨。日均装运量为 8.92 万吨/日，较去年 8 月的 7.28 万吨/日增加 22.52%。

【能化期货】

➤ 俄罗斯将从 9 月 1 日起将石油出口税下调至 52 美元/吨

俄罗斯财政部 8 月 15 日发布声明称，由于 7 月 15 日至 8 月 14 日监测期间乌拉尔石油的平均价格较低，俄罗斯将削减 9 月原油和燃料油的出口关税至 52 美元/吨，较 8 月份下降了 1.9%。

➤ 哈萨克斯坦将于下月开始通过阿塞拜疆管道向西方市场输送石油

消息人士透露，哈萨克斯坦预计将于下个月开始通过阿塞拜疆最大的石油管道“巴库—第比利斯—杰伊汉”向西方市场输送石油，以减少其对把俄罗斯作为过境点的依赖。20 年来，哈萨克斯坦一直依赖途径俄罗斯的里海管道联盟（CPC）向市场出口石油。但自从俄乌冲突以来，这些管道供应曾多次中断。哈萨克斯坦国家石油公司正与阿塞拜疆国家石油公司的贸易部门进行深入谈判，以允许每年多达 150 万吨（3 万桶/日）的哈萨克斯坦石油通过里海运送到巴库。最终合同将于本月底签署，供货将于一个月后开始。

➤ 伊朗正式回应欧盟提出的核协议文本，伊核协议或将达成

在暗示距离与美国达成核协议更进一步，并恢复伊朗面向全球市场的石油出口后，伊朗在北京时间今日凌晨表示已就欧盟方面提出的核协议草案文本发出正式回应。伊朗学生通讯社援引“知情人士”的话称，伊朗对最新协议草案的立场已传达给欧盟首席特使博雷尔，并且将在未来两天内收到欧盟方面的答复，但没有透露更多细节。周一早些时候，伊朗外长表示，“如果美国表现出切实的态度和灵活性”，就可以在未来几天内与美国达成协议，恢复履行核协议。

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。



➤ 欧洲天然气价格自3月8日来首次突破每千立方米2400美元

洲际交易所数据显示，欧洲天然气价格自3月8日来首次突破每千立方米2400美元。根据计算，该交易所最近的天然气期货的平均月结算价格在7月上漲了近50%，从6月份的每千立方米1180美元涨至每千立方米约1805美元，而在去年的仲夏，它还没有超过500美元每千立方米。

【金属期货】

➤ 四川电力保供面临最严峻局面：启动三级保供电调控措施

继8月11日、14日连续两次召开电力保供工作紧急视频会议之后，8月15日，四川再次召开电力保供调度会。记者从会上获悉，当前，全省电力供需形势已由7月份的高峰时期电力“紧缺”，转变为全天电力电量“双缺”的严峻局面，预计全省最大用电负荷将比去年同期增加25%，可以说电力保供已经进入最严峻最极端的时刻。目前，四川已启动三级保供电调控措施，全力保障民生用电。

➤ 2022年8月第2周，巴西商贸部工业品出口数据汇总

①累计装出铁矿石1319.29万吨，去年8月为3468.34万吨。日均装运量为131.93万吨/日，较去年8月的157.65万吨/日减少16.32%；

②累计装出铜矿石和铜精矿11.37万吨，去年8月为11.79万吨。日均装运量为1.14万吨/日，较去年8月的0.54万吨/日增加112.23%；

③累计装出铝矿石和铝精矿6.07万吨，去年8月为44.34万吨。日均装运量为0.61万吨/日，较去年8月的2.02万吨/日减少69.89%。

➤ 国内市场电解铜现货库存6.04万吨，较上周四降0.15万吨

金十期货8月15日讯，据Mysteel，截至8月15日，国内市场电解铜现货库存6.04万吨，较上一周一降0.53万吨，较上周四降0.15万吨。其中，上海库存4.51

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。



万吨，较上一周一降 0.57 万吨，较上周四降 0.16 万吨；广东库存 0.84 万吨，较上一周一增 0.22 万吨，较上周四增 0.08 万吨。

➤ 限电开始影响供应端 8 月精炼锌产量调整至 50.61 万吨

8 月 15 日，据 SMM，四川省由于当前电力供需紧张，为确保四川电网安全，保护民生用电，确保不出现拉闸限电，当地生产企业被要求生产全停，放高温假，让电于民，影响时间为 8 月 15 日 00:00 至 8 月 20 日 24:00。经调研整理，四川省锌冶炼厂受影响量为 4890 吨。则 8 月中国精炼锌预计产量从 51.1 万吨调整至 50.61 万吨，环比增加 6.35%，同比减少 0.55%，1~8 月累积产量预计为 395.3 万吨，累计同比减少 2.2%。

金融市场

➤ 金融

1、有媒体报道称，深圳证监局近日对辖区券商进行窗口指导，叫停大规模外宣活动，仅在公司内部平台作宣传。对此，有接近深圳证监局人士透露，深圳证监局并未叫停辖区证券公司“8.18 理财节”对外宣传，而是针对以往存在的违规宣传情况，做好事前提醒，要求公司依法合规进行宣传，不得误导投资者，切实保护投资者利益。

2、华夏北京保障房 REIT、中金厦门安居 REIT、红土深圳安居 REIT 首批三只保障性租赁住房 REITs 今日正式发售，预计募资总额约 38 亿元。网下询价结果显示，三只产品的机构投资者拟认购份额数量均超过 100 倍，其中红土深圳安居

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。



REIT 拟认购数量超过 133 倍，刷新公募 REITs 网下询价认购倍数新纪录。据测算，本次将有约 1220 亿元的机构资金抢购上述保租房 REITs 新品。

3、中基协发布声明称，个别律师事务所及工作人员为推介法律服务，通过诱导营销、夸大宣传等方式对行业机构“定点”投放揽客信息，甚至影射、暗示其与协会有“特殊渠道”。协会正在有针对性地采取相应措施。中基协表示，中介服务机构不应损害自身、对方机构及投资者合法权益，协会也从未委托或指定任何中介服务机构或个人办理相关业务，从未收取任何费用。

4、知名基金经理、运舟资本投资总监周应波“奔私”后首发产品火热，新产品首日募集金额合计超过 30 亿元。

➤ 楼市

1、据证券时报，针对南京限贷政策放松的传闻，中行、建行、工行、招行等多家银行南京分行或支行贷款部门相关工作人员均表示，目前未收到明确调整通知。

2、广东惠州个人住房贷款最低首付比例正式下调，居民家庭首次购买普通住房首付降至两成，对于居民家庭首次购买非普通住房的商业性个人住房贷款，最低首付款比例不低于 30%。

➤ 产业

1、交通运输部等六部门部署启动新一轮农村公路建设和改造，2022 年计划新增完成新改建农村公路 3 万公里、实施农村公路安全生命防护工程 3 万公里、改造农村公路危桥 3000 座，力争新增完成投资约 1000 亿元，带动约 200 万人次就地就近就业增收。

2、科技部支持建设新一代人工智能示范应用场景，首批支持建设十个示范应用场景，分别为智慧农场、智能港口、智能矿山、智能工厂、智慧家居、智能教育、自动驾驶、智能诊疗、智慧法院、智能供应链。

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、工信部信息通信经济专家委员会委员刘兴亮表示，公开数据显示，集中在消费电子领域，尤其是在面板用芯片、通信用芯片、模拟芯片等众多大类芯片中，价格降幅都不小。其中，大部分近两月内跌价超过20%，部分芯片降价超80%。

4、据交通运输部，7月份公路水路交通固定资产投资达2591亿元，同比增长7.5%；其中公路投资2452亿元，同比增长6.8%。7月全国港口货物吞吐量同比增长5.7%，集装箱吞吐量增长11.2%，水路货运量增长7.2%，公路货运量下降3.8%。

5、四川再次召开电力保供调度会。当前全省电力供需形势已由7月份的高峰时期电力“紧缺”，转变为全天电力电量“双缺”的严峻局面，预计全省最大用电负荷将比去年同期增加25%。目前，四川已启动三级保供电调控措施，全力保障民生用电。

6、四川省决定对部分工业电力用户实施停产措施，四川当地硅料、硅片及电池片等各级光伏生产企业生产按下“暂停键”。分析认为，由于硅料产业集中度高，任何一家头部厂商的限电停产都会导致整体供应短缺，进而引发硅料价格继续上涨。而组件价格已经处于高位，且难将涨价成本完全传导给终端客户。

7、广州南沙区拟设置元宇宙产业集聚区先导示范区，符合准入条件、3人及以上团队即可申请入驻集聚区先导示范区，人均办公面积最高10m²，最高免租三年。

8、小鹏汽车CEO何小鹏表示，随着超快充技术的发展，20万元以上纯电车销量将会爆发，10万元以下燃油车将被纯电车快速取代，10万-20万元区间内燃油车将被混动和纯电车型冲击，混动表现更突出。

➤ 海外

1、日本第二季度实际GDP环比增长0.5%，按年率计算增幅为2.2%，均低于经济学家预期，但较一季度明显改善。尽管日本经济有所恢复，但经济学家预计，日本央行将坚持目前的宽松政策，并继续为受到大流行和物价上涨双重打击的家庭提供支持。

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、美国8月NAHB房产市场指数下降6个点至49，创2007年美国楼市崩塌以来最大降幅，连续第八个月下滑，并创2020年5月以来新低，此前市场预期将持平于55。

3、美国8月纽约联储制造业指数为-31.3，创2020年5月以来新低，预期5.5，前值11.1。

4、加拿大6月批发销售同比升12.2%，前值升11.7%；环比升0.1%，预期升0.5%，前值升1.6%。

➤ 国际股市

1、热门中概股多数上涨，智富涨115.69%，兆新能源涨62.62%，优客工厂涨13.73%，斗鱼涨8.8%，迅雷涨8.64%，金太阳教育涨7.77%，腾讯音乐涨5.9%；跌幅方面，洋葱跌16.09%，趣活科技跌11.46%，怪兽充电跌7.21%，小牛电动跌6.71%；中概新能源汽车股涨跌不一，蔚来汽车涨0.99%，小鹏汽车跌3.77%，理想汽车涨0.22%。

2、特斯拉上海超级工厂第100万辆整车下线。特斯拉对外事务副总裁陶琳表示，上海工厂团队由99.9%的中国人组成，供应链本地化率已经超过95%。

3、苹果一项新型专利公布，为一种可用于未来手表型号的氧化锆陶瓷材料，该材料也可能用于iPhone，这意味着苹果未来可能推出陶瓷材质版的iPhone。

4、苹果计划扩大其广告业务，这将使其在大幅提高收入的同时，与社交媒体巨头发生正面冲突。据悉，苹果正考虑在Apple Maps上添加广告，并可能在Podcasts和Books的数字商店中插入广告。报道称，苹果公司每年从广告业务中获得约40亿美元的收入，并希望这部分业务收入能突破百亿美元。

5、美国辉瑞公司首席执行官艾伯乐新冠病毒检测结果呈阳性。他表示，目前症状轻微，正在隔离并遵循公共卫生预防措施。

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、法拉第未来宣布新融资，称新担保票据工具提供 5200 万美元承诺资金，并表示正与多个投资者积极商谈追加融资事宜，且加州汉福德制造工厂已接近完工。

7、斗鱼第二季度总营收为 18.33 亿元，环比增 2.1%；调整后净利润 2350 万元，上年同期为亏损 1.45 亿元。二季度移动端平均月活跃用户为 5570 万，付费用户数为 660 万，环比均小幅增加。

8、腾讯音乐第二季度 ADS 为 0.53 元人民币，预期为 0.36 元。营收 69.1 亿元人民币，预期 66.2 亿元。净利润 8.56 亿元人民币，预期 6.5 亿元。第二季度来自音乐订阅服务的收入为 21.1 亿元人民币，同比增长 17.6%。第二季度在线音乐移动 MAU（月活跃用户数）为 5.93 亿，同比下降 4.8%。第二季度在线音乐服务的付费用户人数为 8270 万人，同比增长 24.9%。腾讯音乐美股盘后涨超 3%。

9、巴菲特旗下的伯克希尔哈撒韦披露的 13F 文件显示，二季度该公司买入西方石油 2218 万股，持仓市值达 93 亿美元，增持苹果 388 万股使总持股数达 8948 万股，减持通用汽车等四只股票。截至二季度末，该公司投资组合规模下降 634 亿美元至 3000 亿美元。

10、老虎环球基金披露的 13F 文件显示，第二季度清仓美股经纪商 Robinhood；新建仓谷歌母公司 Alphabet 221 万股，占其投资组合约 2%；减持 29.5% 的微软持仓至 516 万股，大笔减持京东 1825 万股，持仓市值降至 19.6 亿美元，但仍为其第一重仓股；此外小鹏、理想和拼多多亦遭减持。截止二季度末，老虎环球美股持仓规模为 118.46 亿美元，较上次报告缩水超一半。

11、高瓴旗下 HHLR 第二季度美股持仓披露，HHLR 十大重仓股为百济神州、京东、赛富时、DoorDash、SEA、唯品会、传奇生物、阿里巴巴、贝壳、大全新能源，其中有 7 只是中概股。在 HHLR 二季度全部美股持仓中，中概股合计持有市值近 30 亿美元，市值占比达到了 64%。二季度，科技和新能源依旧是 HHLR 的重点投资方向。

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，苯乙烯跌 3.38%，PTA 跌 3.04%，短纤跌 2.3%，20 号胶跌 2.3%，沥青跌 1.99%，橡胶跌 1.79%。黑色系普遍下跌，铁矿石跌 1.94%，热卷跌 1.57%，螺纹钢跌 1.01%。农产品多数下跌，菜油跌 4.82%，菜粕跌 2.17%，棕榈油跌 1.91%，豆粕跌 1.86%，豆油跌 1.75%，豆二跌 1.61%。

2、据中国气象局预测，今年我国汛期气候状况总体偏差，极端天气事件偏多，旱涝灾害较重。统计局表示，8、9 月份是秋粮产量形成的关键时期，要密切关注自然灾害、病虫害等对粮食生产的影响，确保秋粮稳产丰收，全年粮食产量稳定在 1.3 万亿斤以上。

3、中钢协统计显示，8 月上旬，重点统计钢铁企业粗钢日产 194.33 万吨，环比增长 2.81%；生铁日产 179.00 万吨，环比增长 2.01%；钢材日产 194.26 万吨，环比增长 2.89%。

4、俄罗斯财政部发布公告称，自 9 月 1 日起将石油出口税下调 1 美元至每吨 52 美元。

5、德国财政部长林德纳表示，德国希望免除天然气附加费的增值税，但这需要欧盟批准。德国政府已致函欧盟委员会请求豁免。

6、菲律宾 1-7 月煤炭进口量累计为 1766.4 万吨，同比增长 8.9%。其中，7 月份菲律宾煤炭进口 285.7 万吨，同比增长 4.5%，环比下降 9.5%。

7、波罗的海干散货指数跌 4.94%，报 1404 点，再度刷新逾半年新低。

➤ 债券

1、政策利率意外调降点燃做多热情，现券期货大涨。银行间利率债收益率大幅下行 7-15bp，中短券表现更好，1 年期国债活跃券 220014 收益率下行 14.87bp

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。



报 1.68%；国债期货全线大幅收涨，10 年期主力合约涨 0.7%，创逾两年收盘新高，5 年期主力合约涨 0.52%；主要利率互换大幅下行逾 10bp；地产债整体走弱多数下跌，“20 融创 02”跌超 23%，“21 碧地 01”和“21 融创 01”跌 20%。

2、中证转债指数收盘涨 0.48%，成交额 564.66 亿元；万得可转债等权指数收盘涨 0.47%，成交额 622.1 亿元；祥鑫转债涨超 12%，雷迪转债涨超 9%，铂科转债和翔鹭转债均涨超 7%，北方转债、“上 22 转债”和中钢转债均涨逾 6%；岩土转债跌近 7%，城市转债跌超 4%，伯特转债跌逾 3%。

3、央行上海总部：截至 7 月末，境外机构持有银行间市场债券 3.51 万亿元，约占银行间债券市场总托管量的 2.9%。

4、国家发改委公布 2021 年度企业债券主承销商和信用评级机构信用评价结果，天风证券、中金公司等 25 家券商获得 A 类评级，招商证券、光大证券等 47 家券商为 B 类，摩根士丹利证券等 13 家为 C 类；中诚信国际在 7 家受评信用评级机构中得分最高，大公资信则得分垫底。对于评价结果靠后的主承销商和信用评级机构，发改委要求对其承销、评级的项目加大监管力度。

5、深交所落地首批组合型信用保护合约，8 家 CDX 合约核心交易商共计达成合约 32 笔，名义本金合计 9 亿元。

6、标普：将斯里兰卡债券评级降为“D”；确认其“SD/SD”外币和“CCC-/C”本币评级，长期本币评级前景展望为负面。

7、“20 宝龙 MTN001”“20 世茂 G3”持有人会议拟审议本息展期兑付等议案；“17 汉当科 MTN002”展期本金及利息议案未获通过；穆迪确认交银国际“A3”长期发行人评级，展望下调至“负面”；鹏元国际上调交通银行国际评级至“A+”，展望稳定；中国林业集团原总经理林展正接受调查；绵阳科技城投资总经理郭旭东被调查；洛娃集团被法院裁定破产；金地集团子公司首期市场化累计购买 1.3 亿元公司债。

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、日本6月所持美国国债增加126亿美元，至1.2万亿美元。中国6月所持美债减少130亿美元，至9678亿美元，连续第七个月下降，触及2010年5月以来的最低水平。

➤ 外汇

1、周一在岸人民币兑美元16:30收盘报6.7632，较上一交易日跌283个基点；夜盘收报6.7755，较上一交易日夜盘跌325个基点。人民币兑美元中间价报6.7410，调升3个基点。交易员表示，人民币短期受压走低，市场关注经济复苏表现对汇价的影响，不过汇市反应相较于债市仍较温和。政策利率调整令中美利差倒挂程度增加，境内美元/人民币长端掉期短期或进一步走低。

2、上周三大人民币汇率指数集体下跌。外汇交易中心数据显示，8月12日，CFETS人民币汇率指数报101.88，按周跌0.5；BIS货币篮子人民币汇率指数报107.21，按周跌0.42；SDR货币篮子人民币汇率指数报100.29，按周跌0.25。

3、外汇局表示，7月我国外汇市场运行总体平稳，境内外汇供求延续基本平衡。受分红派息等季节性因素影响，企业、个人等非银行部门涉外收支呈现小幅逆差，属于在平衡区间内的正常波动，8月上旬为上百亿美元顺差。

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
12:30	日本6月第三产业活动指数
14:00	英国7月失业率
17:00	欧元区8月ZEW经济景气/现况指数
17:00	欧元区6月季调后贸易帐
17:00	德国8月ZEW经济景气/现况指数
20:15	加拿大7月新屋开工
20:30	加拿大7月CPI
20:30	美国7月新屋开工
20:30	美国7月营建许可总数
21:15	美国7月工业产出

财经大事

北京时间	事件
9:30	澳洲联储公布货币政策会议纪要
10:00	国家发改委召开8月份新闻发布会
待定	印尼总统维多多发表年度国情咨文，并就2023年预算提案发表讲话

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。