

国内疫情防控措施放松，大宗商品价格大幅反弹

东海期货 | 宏观日报 2022 年 6 月 29 日

研究所 宏观策略组

宏观日报
贾利军

 从业资格证号: F0256916
 投资分析证号: Z0000671
 联系电话: 021-68757181
 邮箱: jialj@qh168.com.cn

明道雨 联系人

联系电话: 021-68758120

1、宏观重要消息及事件:

FOMC 永久票委、纽约联储主席威廉姆斯称，衰退不是他的基本预期。美国长期中性利率没有改变，仍然很低。这就是美联储今年、明年需要大幅加息的原因之一。联邦基金利率达到 3.5%-4% 是合理的，但下次会议是加息 50 个基点还是 75 个基点还需讨论。他还表示，今年肯定需要把利率提高到 3%-3.5%。

据国际文传电讯社称，俄罗斯计划改变谷物和葵花籽出口税的计算公式，并计划将谷物出口税公式与卢布挂钩。

七国集团发布会后公报，重申坚定支持乌克兰，在石油问题上，其称将考虑全面禁止所有能够运输俄罗斯海运石油的服务，除非石油购买价格低于与合作伙伴商定的价格。

一位欧佩克+代表称，欧佩克+成员国 5 月份的原油日产量比它们的总产量目标低 270 万桶/日。该组织最大的石油生产国沙特的执行率为 128%，第二大的生产国俄罗斯的执行率为 383%。自 2020 年 5 月该组织开始减产以来，欧佩克+已比协议要求的产量少了 5.62 亿桶。

欧洲央行行长拉加德表示，欧洲央行仍预计欧洲经济将正增长。她还重申了 7 月将加息 25 个基点。如果有必要，9 月份的加息幅度会更大。如果前景存在不确定性，欧洲央行就要逐步采取行动，但必要时可以选择果断行动。

昨日，国家卫健委发布关于印发新型冠状病毒肺炎防控方案（第九版）的通知，通知内提到，将密切接触者、入境人员隔离管控时间从“14 天集中隔离医学观察+7 天居家健康监测”调整为“7 天集中隔离医学观察+3 天居家健康监测”。

2、全球资产价格走势

	上一日收盘	前值	变动
国际商品期货方面			
布伦特原油	117.99	115.09	2.52%
WTI 原油	111.84	109.57	2.07%
COMEX 黄金	1821.4	1824	-0.14%

COMEX 银	20.855	21.18	-1.53%
LME3 个月铜	8391.5	8357	0.41%
全球主要股票市场			
上证综合指数	3409.21	3379.19	0.89%
恒生指数	22418.97	22229.52	0.85%
美国:道琼斯工业平均指数	30946.99	31438.26	-1.56%
英国富时 100 指数	7323.41	7258.32	0.90%

数据来源：文华财经，东海期货研究所整理

3、国内流动性概况

	上一日收盘	前值	变动 (BP)
SHIBORO/N	1.44	1.44	0
SHIBOR:1 周	1.98	1.99	-1
SHIBOR:3 个月	2.00	2.00	0
R007	2.36	2.36	0
DR007	2.05	2.02	3

数据来源：Wind，东海期货研究所整理

4、重要财经日历

- 1、待定 第 184 届欧佩克大会举行
- 2、17:00 欧元区 6 月消费者信心指数终值
- 3、20:00 德国 6 月 CPI 月率初值
- 4、20:30 美国第一季度实际 GDP 年化季率终值
- 5、21:00 美联储、欧洲央行、英国央行行长发表讲话

免责声明：

本报告立足于结合基本面及技术面对市场价格运行趋势及轮廓进行整体判断，提示可能存在的投资风险与投资机会。报告中的信息均源自于公开材料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。报告仅作参考之用，在任何情况下均不构成对所述期货品种的买卖建议，我们也不承担因根据本报告操作而导致的损失。

联系方式：

公司地址：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 层

邮政编码：200125

公司网址：www.qh168.com.cn