

- 1、美国至10月13日当周API原油库存减少438.3万桶，库欣原油库存减少100.5万桶，汽油库存减少157.8万桶，馏分油库存减少61.2万桶。
- 2、据了解交易情况的人士说，墨西哥一直在实施其年度石油出口对冲计划——通过购买看跌期权，以预先确定的价格出售原油，对冲过程可能即将或已经完成。知情人士称，墨西哥一直将油价目标定在每桶80美元左右。墨西哥的“Hacienda对冲”历来是全球最大主权石油对冲之一，价值约10亿美元。根据机构汇编的数据，对冲过程的迹象首次出现在8月份，当时持续数月的波动性下降突然停止。自那以来，波动性稳步上升，不过这一波动也受到石油市场动荡时期的推动——油价在每桶85美元至100美元之间迅速反弹。
- 3、巴以冲突及其衍生的供应风险已经成为当前市场最重要的边际干扰项。由于风险涉及了全球原油主产国，其对市场的潜在影响力可以完全覆盖当前其他市场矛盾。未来行情将反复在风险事件导致的风险溢价，以及市场随后结合实际上的供应端变化所作的事后修正中摇摆，预计原油波动率会大幅增加。鉴于巴以冲突衍生的行情是事件性的，因此单边不确定性较高，无论是在冲突逐渐加剧还是逐渐淡化期间，都建议使用对应方向的买入虚值期权去表达，此外也可以考虑使用期权结构逢低做多原油波动率。
- 4、加拿大会计和咨询公司RSM Canada经济学家Tu Nguyen说，根据加拿大9月份CPI报告的数据，大幅加息的滞后影响正在显现。尽管汽油价格居高不下，住房成本也在不断上涨，但各类价格的涨幅普遍放缓，其中包括食品价格。这可能反映了消费者支出的回落，因为随着加拿大的抵押贷款（通常为5年期）到期，家庭面临更高的债务支付。Nguyen补充说：“消费者需求的疲软使得企业提价的空间减少。加拿大银行本周公布的第三季度商业调查显示，近一半的企业表示加息的影响才刚刚开始显现。”
- 5、上海石油天然气交易中心消息，中国海油与法国ENGIE17日在交易中心国际LNG交易平台达成一笔以人民币结算的国际液化天然气（LNG）交易业务，交易标的为一船约6.5万吨的LNG资源，显示出LNG领域的人民币跨境结算交易逐渐走向常态。
- 7、维多能源集团CEO：预计油价将保持在每桶80至90美元的范围内。欧洲永久失去了部分工业天然气需求。
- 8、在数月谨慎遵守与沙特达成的协议之后，俄罗斯石油流量再次稳步攀升。截至10月15日的七天内，俄罗斯的海运原油出口量出现反弹，使四周平均出口量达到三个多月来的最高水平。油轮跟踪数据显示，上周每天从俄罗斯港口运出约351万桶原油，比前七天每天增加约28.5万桶，使得四周平均日运量提高到约336万桶。俄罗斯副总理诺瓦克在8月初表示将把出口限制措施延长至年底，每天出口量将比5-6月平均水平减少30万桶。自9月初以来，相对于这一目标，四周平均装运量一直在逐步上升，最近一段时间每天超出约8万桶。
- 9、10月16日，国家能源局组织召开2023-2024年采暖季天然气保供专题会议。会议要求，油气央企要继续带头保供稳价，坚持立足国内全力增储上产，确保储气库满库入冬，“全国一张网”安全稳定运行，千方百计保障采暖季天然气供应平稳。会议强调，要坚持天然气市场化改革方向，强化供用气合同签订和履约执行，做好合同内应急、合同内保供。会议还细化梳理了采暖季保供形势，针对性部署了部分重点地区、重点时段或重点环节天然气保供工作，并提出了相关工作要求。
- 10、沙特阿美首席执行官：石油市场的情况是平衡且合理的。计划到2027年将产能提高到1300万桶/日的目标进展顺利。如果我们想增加石油产量，我们可以在几周内实现。目前天然气市场的波动是由于缺乏备用产能。目前石油市场有300万桶/日的剩余产能。我们正在考虑扩大零售业务。
- 11、据CME“美联储观察”：美联储11月维持利率在5.25%-5.50%区间不变的概率为90.2%，加息25个基点至5.50%-5.75%区间的概率为9.8%。到12月维持利率不变的概率为56.1%，累计加息25个基点概率为40.2%，累计加息50个基点概率为3.7%。

作者: 强子益

期货从业资格证号: F3071828

投资咨询从业资格证号: Z0015283

电话: 021-20627563

邮箱: qiangziyi@sd-gold.com

审核: 曹有明

期货从业资格证号: F3038998

投资咨询从业资格证号: Z0013162

电话: 021-20627258

邮箱: caoyouming@sd-gold.com

免责声明:

本报告由山金期货投资咨询部制作，未获得山金期货有限公司的书面授权，任何人和单位不得对本报告进行任何形式的修改、发布和复制；本报告基于本公司期货研究人员采用可信的公开资料和实地调研资料，但本公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，且本报告中的资料、建议、预测均反映报告初次发布时的判断，可能会随时调整，报告中的信息或所表达的意见不构成投资、法律、会计或税务的最终操作建议，本公司不就报告中的内容对最终操作建议作任何担保；在山金期货有限公司及其研究人员知情的范围内，山金期货有限公司及其期货研究人员以及财产上的利害关系人与所评价或推荐的产品不存在任何利害关系，同时提醒期货投资者，期市有风险，入市须谨慎；