

资讯速递

金石期货研究所，2021年8月17日

晚间收盘情况

商品期货中**涨幅前三**的品种为：锰硅 2109 涨 2.97%、沪锡 2109 涨 2.43%和红枣 2201 涨 1.92%；**跌幅前三**：苯乙烯 2109 跌 2.86%、生猪 2109 跌 2.52%和燃油 2201 跌 2.37%。

农产品市场情况

1、红枣价格上涨 客商拿货积极 成交量放大，据中枣网，沧州市场热销货源需求量不断加大，部分前期停工的加工厂现阶段已开工，冷库交易转票现象相对较多，整体购销积极。产区价格维持前期上涨水平，近期前来询价找货客商增多，成交优质优价。广州如意坊批发市场今日上货七车，其中某果业公司上货二车，市场人流量大幅增加，客商拿货成交量加大，价格上涨明显。

2、后期鸡蛋现货有望开启季节性上涨行情，据生意社，今日石家庄鸡蛋国产的出厂报价为 9.64/公斤，唐山市鸡蛋国产的出厂报价为 9.64 元/公斤。后期随着梅雨季节结束，高温天气到来，受高温天气影响，全国各地高峰期蛋鸡产蛋率普遍下降，现货有望开启季节性上涨行情。

3、大商所：调整玉米锦州港地区部分指定交割仓库（厂库）升贴水，大连商品交易所发布公告称，将调整玉米锦州港地区部分指定交割仓库（厂库）的升贴水，具体为：锦州港股份有限公司、路易达孚（上海）有限公司、中粮贸易有限公司、大连象屿农产有限公司的贴水由-5 元/吨调整至 0 元/吨。自玉米 2209 合约起实施。

4、SEA：印度 7 月棕榈油进口量下滑 43%至五个月来最低水平，印度溶剂萃取者协会（SEA）今日表示，印度棕榈油进口量 7 月下降 43%至 465606 吨，这是五个月来最低水平，因价格上涨至数月高位之后，需求受限。豆油进口量

下滑 22%至 379892 吨。

5、发改委：随着消费趋旺，生猪养殖利润可能逐步回升。国家发展改革委新闻发言人表示，虽然前期生猪价格下降对养殖利润产生了一定影响，但国内生猪产能总体恢复势头良好。据监测，截至 7 月底，全国生猪存栏同比增长 31.2%，其中能繁母猪存栏同比增长 24.5%，已经恢复至正常年份水平。未来一段时期，随着消费趋旺，生猪养殖利润可能逐步回升，将在一定程度上提振养殖场和养殖户的积极性。

6、昨国内棉花现货企业报价涨 200-250，部分企业销售基差轮换，对应 CF201 新疆库 310-590，内地库 600-1000。郑棉全线上涨，点价少量成交。纺企采购积极性不佳，成交清淡。

7、据中国棉花信息网分析，结合贸易商前期订货、船期安排及棉花到港等因素，预计 7 月棉花进口量将明显减少，或仅 12 万吨左右。8、9 月预计仍将维持低位，呈现持续减少态势。

8、郑棉冲上 18000 大关，周末山东、河南、江浙等地商家再次上调棉纱价格，部分观望。昨观望商家也有一定补涨，多数上涨 200-300 元/吨，但市场订纱量很小。江浙、广佛对精梳 40S 及以上高支类已无人问津。

金属市场情况

1、新疆阿拉山口口岸暂停运营，据 Mysteel，今日阿拉山口口岸仍暂停运营，相关人员全部隔离。本次恢复运营时间暂时无法确定，昨日口岸关闭之前已发出货物均可正常进厂，目前冶炼厂正常生产。若口岸暂停时间持续，不排除会影响到冶炼厂的后续运营。据调研，西北铜冶炼厂的铜精矿厂内库存天数在 10-60 天。阿拉山口是我国进口内陆铜精矿，特别是哈萨克斯坦矿的主要口岸。2020 年中国从哈萨克斯坦进口铜精矿 80 万吨，占比 4%。

2、8 月 17 日日照港铁矿石现货报价平稳，8 月 17 日铁矿石日照港口现货早盘报价平稳，现 PB 粉 61.5%报 1129 稳，纽曼粉 62.5%报 1150 稳，金布巴粉 60.5%报 1030 稳，罗伊山粉 61%报 1052 稳，卡粉 65%报 1535 稳，超特粉 56.5%报 777 稳（元/湿吨）。基差方面：与 16 日收盘价对比，日照港澳大利亚

PB 粉矿 (车板价, 61.5%) (换算干湿后) 现货升 376.7。

8月17日山西吕梁焦煤报价平稳, 8月17日国内焦煤现货主流价格平稳, 现吕梁主焦煤 (A9.5, V21-23, S0.7, G>85) 柳林出厂价 2480 元/吨。基差方面: 与 16 日午后收盘价对比, 焦煤现货升水 300。

8月17日天津港准一级焦现货价格平稳, 8月17日国内焦炭现货价格平稳, 现天津港准一级冶金焦 (A<12.5, S<0.7, CSR>60,M8) 平仓价 3110 元/吨。基差方面: 与 16 日午后收盘价对比, 扣除水分后, 焦炭现货升水 254。

8月17日国内各地热卷报价稳中涨 10, 8月17日国内各地热轧卷板现货报价稳中涨 10, 现 Q235B, 4.75mm, 上海鞍钢/本钢报价 5760 涨 10, 北京包钢 5850 稳, 广州柳钢报 5650 稳。基差方面: 与 16 日午后收盘价对比, 上海现货升水 131, 北京现货升水 221, 广州现货升水 71。(单位: 元/吨)

8月17日国内建材现货报价平稳, 8月17日国内建筑钢材现货报价平稳, 现 HRB400,20mm, 上海中天报价 5310 稳, 北京河钢报价 5230 稳, 广州韶钢报 5580 稳。基差方面: 与 16 日午后收盘价对比, 上海现货升水 146.2, 北京现货升水 63.8, 广州现货升水 252。(单位: 元/吨)

LME 有色金属现货升贴水, 8月17日 LME0-3 铜贴水 22.5 美元/吨, LME0-3 铝升水 17.25 美元/吨, LME0-3 铅升水 120.5 美元/吨, LME0-3 锌贴水 6.75 美元/吨, LME0-3 锡升水 555 美元/吨, LME0-3 镍贴水 12.25 美元/吨。

化工市场情况

1、PVC 延续季节性去库, 库存环比持平, 截至 8 月 16 日, 国内 PVC 社会库存在 12.2 万吨, 环比持平, 同比下降 54.31%; 其中华东地区在 9.1 万吨, 环比减少 1.09%, 同比下降 58.45%; 华南地区在 3.1 万吨, 环比增加 3.33%, 同比下降 35.42%。PVC 继续季节性去库, 社会库存处历年低位。下游需求维持平稳, PVC 生产企业出货顺畅, 制品企业低库存接单生产。

2、昨日, PVC 现货市场价格窄幅调整。上游生产企业报价部分上调, 市场贸易商报价变化不大。目前 09 合约处于减仓阶段, 市场存在一定波动。下游按需采购, 采购情绪不高。预计短期 PVC 现货市场价格小幅波动为主。

3、市场对德尔塔变异毒株持续蔓延可能阻碍经济复苏的担忧加剧，主要新兴市场国家的炼油产量和经济活动放缓，国际油价三连跌。NYMEX 原油期货 09 合约 67.29 跌 1.15 美元/桶或 1.68%；ICE 布油期货 10 合约 69.51 跌 1.08 美元/桶或 1.53%。中国 INE 原油期货主力合约 2110 跌 2.6 至 429.3 元/桶，夜盘跌 5.1 至 424.2 元/桶。

免责声明：本报告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，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。我们已力求报告内容的客观、公正，但文中的观点、结论和建议仅供参考，报告中的信息或意见并不构成所述品种的操作依据，投资者据此做出的任何投资决策与本公司和作者无关。

