

资讯速递

金石期货研究所，2021 年 12 月 30 日

晚间收盘情况

商品期货中**涨幅前三**的品种为：沪铝 2202 涨 2.97%、纸浆 2205 涨 2.70%、和不锈钢 2202 涨 2.44%；**跌幅前三**：液化气 2202 跌 2.29%、纯碱 2205 跌 2.22%、锰硅 2205 跌 1.82%。

农产品市场情况

1、Anec 预期巴西 2021 年玉米出口量将为五年来最低，据巴西谷物出口商协会(Anec)最新发布的预估显示，巴西 2021 年玉米出口量将为 2,070 万吨，创 2016 年以来最低。由于年内旱情以及霜冻天气冲击产量，巴西 2021 年谷物出口势将减少。Anec 预期，巴西今年玉米出口量将较 2020 年相比减少 38%，而去年的出口量已然低于 2019 年所创的 4,120 万吨纪录高位。

2、2021 年 1-10 月中国在美国家纺进口市场份额下降，在欧盟份额略增，据中国纺织品进出口商会 12 月 29 日报告：2021 年 1-10 月，美国和欧盟家纺进口大幅增长，且超过疫情前水平，日本增幅较平稳，与疫情前水平基本持平；其中美国同比增幅高达 37%，比 2019 年同期增长 24.6%；欧盟同比增长 28.7%，比 2019 年同期增长 16.9%；而日本小幅增长 8.9%，与 2019 年同期相比微涨 0.8%。中国在美国市场份额下降 3 个百分点，在日本市场份额略有下降，而在欧盟份额略增。印度在美欧日的市场份额均有较大提升。

3、江浙纺织：市场行情也有所走淡，开机率小幅下降，据布工厂，**坯布库存**：12 月 29 日坯布织造库存为 33.5 天左右，目前织造企业基本恢复正常生产，但近期由于市场走货下降，坯布库存小幅上升。织机开机率：12 月 29 日盛泽地区喷水、喷气织机开机率维持在 71%左右。目前苏州地区限产解除，但市场行情也有所走淡，开机率小幅下降。**坯布/面料交易**：据对 350 家被采价单位反馈的数

据监测分析，12月29日商务部中国•盛泽丝绸化纤指数小幅上涨，其中化纤面料价格指数收盘于100.8点，与上一交易日相比，上升了0.17点。**化纤面料利润**：原料方面，近日原料价格波动较大，但产销一般；坯布方面，整体坯布价格较为稳定，坯布利润稳定。

4、坯布印染：近期订单情况一般，坯布、纱线价格继续下行，大耀纺织12月30日消息，1、近期订单情况一般，出货相对前期有所减少，以小批量补单为主，基本没有囤货现象，大多按需采购下单，临近年底，主要还是以赶货和回收货款为主。2、近期家纺市场惨淡，以询价找样为主，实单较少，虽然郑棉期货价格没继续下跌，但近年关，企业对资金有需求、继续抛库存，坯布、纱线价格继续下行。坯布工厂普遍订单不足，部分工厂减少开班。染厂也相对空闲，交期7~10天。3、近期接近年底订单一般，客户基本以报价和开发明年的订单为主，染厂面料订单已经排满年前的面料出货还有压力，国外出口纱线由于海运费持续涨价客户持续下单受阻处于观望状态。

金属市场情况

1、工信部：到2025年粗钢、水泥等重点原材料大宗产品产能只减不增，据财联社，中国工信部等部门发布“十四五”原材料工业发展规划，发展目标包括：到2025年粗钢、水泥等重点原材料大宗产品产能只减不增，产能利用率保持在合理水平。钢铁行业吨钢综合能耗降低2%，水泥产品单位熟料能耗水平降低3.7%，电解铝碳排放下降5%。

2、印度拟降低钢铁、铝、铜等产品的进口关税，据外媒，印度政府部门消息人士12月28日透露，在2022年2月向议会提交2022-2023年国家预算之前，印度财政部已会同其他部委官员就降低钢铁、铝、铜等一系列商品的进口关税相关事宜展开讨论。该举措是为了缓解商品价格飙升给中小微型企业(MSMEs)带来的成本压力，并确保其他工业企业从新冠肺炎疫情的影响中恢复过来。

3、12月30日照港铁矿石现货报价上涨，基差走弱，12月30日铁矿石日照港口现货报价上涨，现PB粉61.5%报775涨6，纽曼粉62.5%报786涨6，金布巴粉60.5%报626涨6，罗伊山粉61%报725涨6，卡粉65%报946涨6，

超特粉 56.5%报 474 涨 6 (元/湿吨)。基差方面 (2205 合约): 与 29 日收盘价对比,日照港澳澳大利亚 PB 粉矿(车板价,61.5%)(换算干湿后)现货升水 179.4。

12 月 30 日天津港准一级焦现货报价平稳,12 月 30 日国内焦炭现货报价平稳,现天津港准一级冶金焦 (A<12.5, S<0.7, CSR>60,M8) 平仓价 2710 元/吨。基差方面 (2205 合约): 与 29 日午后收盘价对比,扣除水分后,焦炭现货贴水 174。

12 月 30 日山西吕梁焦煤价格平稳,基差走弱,12 月 30 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 1900 元/吨。基差方面 (2205 合约): 与 29 日午后收盘价对比,焦煤现货贴水 286。

12 月 30 日国内各地热卷报价涨跌互现,基差走弱,12 月 30 日国内各地热轧卷板现货报价涨跌互现,现 Q235B,4.75mm,上海鞍钢/本钢报价 4860 涨 10,北京包钢 4800 跌 20,广州柳钢报 4760 涨 10。基差方面 (2205 合约): 与 29 日午后收盘价对比,上海现货升水 404,北京现货升水 344,广州现货升水 304。

(单位:元/吨)

4、LME 有色金属现货升贴水,12 月 30 日 LME0-3 铜升水 45 美元/吨,LME0-3 铝贴水 1.25 美元/吨,LME0-3 铅升水 29.75 美元/吨,LME0-3 锌升水 40 美元/吨,LME0-3 锡升水 585 美元/吨,LME0-3 镍升水 115 美元/吨。

5、秘鲁政府仍远未就 Las Bambas 铜矿道路封锁达成协议,据外媒,一名社区顾问和一名政府消息人士周三表示,就五矿国际旗下 Las Bambas 铜矿重启事宜,秘鲁政府仍远未与当地社区达成协议。此前 Chumbivilcas 社区短期内解除对该铜矿道路的封锁,秘鲁总理米尔塔·瓦斯奎兹将于周四春比维尔卡斯,这是政府迄今为止最雄心勃勃的努力,以促成重启协议。

宏观及化工市场情况

1、银行年底遭遇罕见“资产荒”,21 世纪经济报道近期调查发现,进入 2021 年末,部分银行分支机构遭遇罕见的“资产荒”现象。部分地区中小微企业信贷需求不足,导致银行普惠贷款一度面临投放难题,国有大行部分基层网点普惠贷款投放面临不小压力。业内人士表示,通过适度放宽经营贷标准、加大普惠贷款

投放力度，商业银行完成今年普惠贷款任务难度不大。但是商业银行明年一季度“开门红”也将面临不小的压力。再跨周期调整下，如何寻找安全的信贷资产，将继续考验各大银行。

2、美国经济数据：进口大幅增多推动 11 月商品贸易逆差创纪录高位。当月二手房签约量指数意外下滑，受房价高和房源少影响。

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。