

资讯速递

金石期货研究所，2022 年 6 月 13 日

晚间收盘情况

商品期货中**涨幅前三**的品种为：生猪 2209 涨 3.14%、黄金 2208 涨 1.55% 和苹果 2210 涨 1.29%；**跌幅前三**：沪镍 2207 跌 4.80%、尿素 2209 跌 4.43%和沪锡 2207 跌 3.67%。

农产品市场情况

1、2022 年 1-5 月，纺织服装累计出口 7974.7 亿元，同比增长 9.06%，据中国纺织品进出口商会 6 月 9 日发布的报告，5 月中下旬以来，纺织服装主产地疫情逐步好转，各地在稳外贸政策的帮扶下，积极推动复工复产、打通物流供应链。在外需稳定的情况下，前期受阻的出口量得到充分释放，拉动当月纺织服装出口恢复快速增长。纺织品服装出口按人民币计：2022 年 1-5 月，纺织服装累计出口 7974.7 亿元，比去年同期（下同）增长 9.06%，其中纺织品出口 4007.2 亿元，增长 10.01%，服装出口 3967.5 亿元，增长 8.12%。5 月，纺织服装出口 1872 亿元，增长 18.38%，环比增长 24.54%，其中纺织品出口 898.4 亿元，增长 13.97%，环比增长 15.03 %，服装出口 973.6 亿元，增长 22.76%，环比增长 34.83%。

2、农业农村部：本月下调 2021/22 年度棉花进口量估计 10 万吨，新年度棉花供需数据较上月保持不变，据农业农村部 10 日发布 2022 年 6 月中国农产品供需形势分析，本月估计，考虑到待售新棉规模较大、棉花价格外强内弱价差明显、棉花下游需求疲软等因素，本月将 2021/22 年度棉花进口下调 10 万吨至 200 万吨。本月预测，2022/23 年度棉花供需数据与上月保持不变。当前，新疆棉花处于第五真叶至现蕾期，黄河流域和长江流域大部处于第三真叶至第五真叶期，全国棉区综合气象条件适宜，棉花长势总体良好，后期将持续关注气候对单产的

影响。

3、USDA 6 月月报，新年度全球产量调增，消费及贸易量均略有调减，尽管期末库存仍呈下降态势，但消费预期调减增强市场对于全球需求复苏放缓的担忧情绪。

4、农业农村部：预计 2022/23 年度全球大豆供需形势将趋于宽松，据农业农村部，本月中国大豆供需平衡表预测数与上月保持一致。东北产区大豆播种基本结束，大部地区土壤墒情正常，部分播种较早的地区大豆已经出苗。国产大豆需求总体稳定，南方地区逐渐进入季节性消费淡季，市场购销放缓。南美巴西和阿根廷大豆收获工作接近完成，产量高于此前预期，但总体低于去年水平，出口供应预计减少。美国新季大豆播种进度较前期加快，已接近五年同期均值；陈豆压榨和出口需求旺盛，价格持续高位运行。预计 2022/23 年度全球大豆供需形势将趋于宽松。

5、农业农村部：预计 2022/23 年度中国食用植物油消费量 3634 万吨，据农业农村部，本月估计，2021/22 年度中国食用植物油产量 2815 万吨，消费量 3634 万吨，与上月估计值保持一致。截至 5 月底，中国冬油菜主产区大部分已收获完毕，江苏、西南等部分地区收获接近尾声。大部分产区气象条件良好，利于油菜籽收获及晾晒。近期云南、贵州西南部和四川南部等地雨水较多，需关注对油菜籽品质的影响。受国际市场棕榈油、豆油价格重心整体上移影响，对本年度棕榈油到港价、进口豆油税后价均价区间进行适当调整，中国食用植物油进口量调减为 743 万吨。本月预测，2022/23 年度中国食用植物油产量 2925 万吨，进口量 843 万吨，消费量 3634 万吨，维持上月预测值不变。

6、中储粮：全面启动中央储备粮轮换收购，收购均价高于最低收购价，据上证报，记者从中国储备粮管理集团有限公司获悉，随着此前大规模小麦机收全面展开，中储粮在湖北、江苏、河南、山东、安徽等省份已陆续启动小麦轮换收购。截至目前，累计收购 11 万吨，收购均价 3000-3100 元/吨，收购均价高于最低收购价水平，有力促进了农民增收，积极发挥储备轮换收购对市场化收购的带动作用。

1、LME 有色金属现货升贴水, 6 月 13 日 LME0-3 铜贴水 0.25 美元/吨, LME0-3 铝贴水 19 美元/吨, LME0-3 铅贴水 4.25 美元/吨, LME0-3 锌升水 14.25 美元/吨, LME0-3 锡升水 300 美元/吨, LME0-3 镍贴水 76 美元/吨。

2、6 月 13 日山西吕梁焦煤报价平稳, 6 月 13 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 2600 元/吨。基差方面 (2209 合约): 与 10 日午后收盘价对比, 焦煤现货贴水 263.5。

6 月 13 日照港铁矿石现货报价下跌, 6 月 13 日铁矿石日照港口现货报价下跌, 现 PB 粉 61.5%报 968 跌 7, 纽曼粉 62.5%报 980 跌 7, 金布巴粉 60.5%报 893 跌 7, 罗伊山粉 61%报 923 跌 7, 卡粉 65%报 1152 跌 8, 超特粉 56.5%报 814 跌 6 (元/湿吨)。基差方面 (2209 合约): 与 10 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) 现货升水 137.7。

6 月 13 日天津港准一级焦现货报价持稳, 6 月 13 日国内焦炭现货报价持稳, 现天津港准一级冶金焦 (A<12.5, S<0.7, CSR>60,M8) 平仓价 3310 元/吨。基差方面: 与 10 日午后收盘价对比, 扣除水分后, 焦炭现货贴水 292。

6 月 13 日国内各地热卷报价下跌, 6 月 13 日国内各地热轧卷板现货报价下跌, 现 Q235B, 4.75mm, 上海鞍钢/本钢报价 4820 跌 50, 北京包钢报 4860 跌 20, 广州柳钢报 4790 跌 30。基差方面: 与 10 日午后收盘价对比, 上海现货贴水 60, 北京现货升水 7 贴水 20, 广州现货贴水 90。(单位: 元/吨)

3、秘鲁成立 Las bambas 铜矿临时工作组, 据外媒, 秘鲁当局成立了一个临时工作组, 以监控中国矿业公司 MMG 和抗议其 Las Bambas 铜矿的土著社区达成的承诺的进程。抗议活动于 4 月中旬由富埃拉班巴 (Fuerabamba)和万翠尔 (Huancuire) 社区发起, 他们说 Las Bambas 铜矿没有兑现对他们的所有承诺。委员会将负责为各方制定程序和时间表, 以履行其已承诺的承诺, 并评估为履行此类承诺而采取的行动的结果。工作组必须在未来 10 天内成立, 自安装之日起 60 天内有效, 还必须建立六个小组, 负责执行与每个社区相关的具体协议参与谈判。

4、几内亚延长铝土矿商提出建设精炼厂计划的最后期限，据外媒，几内亚军政府周五在一份声明表示，要求铝土矿开采企业在 10 天内提交建造氧化铝冶炼厂的时间表，延长了矿业企业未能满足的 5 月底的最后期限。受到最后日期通牒的公司包括几内亚最大的两家铝土矿生产商 Societe Minierede Boke 和 Compagniedes Bauxitede Guinee。到目前为止，几内亚只有一个氧化铝精炼厂，即俄铝拥有的弗里几亚精炼厂。CRU 估计有六家公司在几内亚有建设氧化铝精炼厂的计划，计划总产能为每年 1100 万吨，这些计划大多数处于早期阶段。

宏观及化工市场情况

1、央行：5 月社会融资规模增量 2.79 万亿元，比上年同期多 8399 亿元，据央行，中国 5 月社会融资规模增量 2.79 万亿元，比上年同期多 8399 亿元。预期为 20300 亿元，前值为 9102 亿元。

2、央行：中国 5 月新增人民币贷款 1.89 万亿元，同比多增 3920 亿元，央行数据显示，5 月份人民币贷款增加 1.89 万亿元，同比多增 3920 亿元；预估为 1.223 万亿元，前值为 6454 亿元。分部门看，住户贷款增加 2888 亿元，同比少增 3344 亿元，其中，短期贷款增加 1840 亿元，中长期贷款增加 1047 亿元；企（事）业单位贷款增加 1.53 万亿元，同比多增 7291 亿元，其中，短期贷款增加 2642 亿元，中长期贷款增加 5551 亿元，票据融资增加 7129 亿元；非银行业金融机构贷款增加 461 亿元，同比少增 163 亿元。

3、央行：中国 5 月 M2 同比增长 11.1%，M1 同比增长 4.6%，央行数据显示，5 月末，广义货币(M2)余额 252.7 万亿元，同比增长 11.1%，增速分别比上月末和上年同期高 0.6 个和 2.8 个百分点；狭义货币(M1)余额 64.51 万亿元，同比增长 4.6%，增速分别比上月末和上年同期低 0.5 个和 1.5 个百分点；流通中货币(M0)余额 9.55 万亿元，同比增长 13.5%。当月净回笼现金 80 亿元。

4、央行：5 月末社会融资规模存量同比增长 10.5%，据央行，5 月末社会融资规模存量为 329.19 万亿元，同比增长 10.5%。

5、美国 5 月 CPI 同比增长 8.6%，创 1981 年 12 月以来新高，美国 5 月 CPI 同比增长 8.6%，创 1981 年 12 月以来新高，预期为 8.2%，前值为 8.3%；美

国 5 月核心 CPI 同比增长 6%，预期为 5.9%，前值为 6.2%。美国 5 月 CPI 环比 1%，预期 0.7%，前值 0.3%；美国 5 月核心 CPI 环比 0.6%，预期 0.5%，前值 0.6%。

6、美联储 6 月至少加息 50 个基点的概率为 100%，与美联储议息日期挂钩的掉期显示，美联储 6 月至少加息 50 个基点的概率为 100%，加息 75 个基点的概率为 28.2%，7 月至少加息 50 个基点的概率为 100%，加息 75 个基点的概率为 43.4%，全年余下 5 次会议将累计加息约 245 个基点将利率提高至 3.27%。

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。