

资讯速递

金石期货研究所，2022 年 6 月 15 日

晚间收盘情况

商品期货中**涨幅前三**的品种为：沪锡 2207 涨 1.28%、苹果 2210 涨 0.93% 和生猪 2209 涨 0.60%；**跌幅前三**：焦炭 2209 跌 6.78%、焦煤 2209 跌 5.95%和硅铁 2209 跌 3.23%。

农产品市场情况

1、棉企亏损加大，地产棉销售加快，据中国棉花网 6 月 13 日发布的报告，近一周多来，郑棉 CF2209 合约盘面价格持续在 20000-20500 元/吨区间盘整，套保率高的棉花贸易商和轧花厂销售明显提速，而套保率低且库存量比较大的疆内棉花加工企业则面临较大销售压力。截止 6 月中旬前，2021/22 年度皮棉的在库综合成本已达到 24500-25500 元/吨，而疆内库“双 28”机采棉的公重报价约 20600-20800 元/吨，目前亏损幅度普遍达到 3500-4500 元/吨，棉花加工企业销售压力增大。6 月上旬以来，2021/22 年度新疆棉询价出货不温不火，山东、河北、江苏等省地产棉成交情况有所好转，买卖双方僵持局面有所缓和。

2、监测系统调查：2022 年棉花实播面积变化的主要原因有哪些？2022 年 5 月下旬，国家棉花市场监测系统就棉花实播面积展开全国范围专项调查，棉花实播面积变化的主要原因：**1**、2022 年，新疆棉花播种面积增长的主要原因有，一是 2022 年国家继续在新疆实施深化棉花目标价格补贴政策，巩固了新疆棉农的植棉信心；二是 2021 年度新疆籽棉收购价格创 11 年来新高，棉花种植收益明显增加，今年棉农植棉积极性提高；三是随着南疆棉花机械化生产率提高，部分分散的土地进行破梗平地，棉花播种面积进一步增加。**2**、2022 年，内地棉花播种面积继续下降的主要原因有，一是内地棉花机械化率较低，人工采摘成本相对较高，且农资价格大幅上涨，棉农种植积极性下降；二是 2021 年度以来，粮

食价格大幅上涨,部分棉农改种粮食;三是新疆棉花目标补贴水平未在内地实行,棉农植棉意愿持续低迷,内地棉花播种面积延续萎缩态势。不过,随着棉价飙升至 11 年来高位,内地棉农植棉信心有所恢复,内地棉花播种面积降幅显著收窄。

3、农业农村部：全国收获小麦 2.56 亿亩，收获进度 84.1%，农业农村部 14 日发布的小麦机收进度显示，全国已收获小麦面积 2.56 亿亩，收获进度 84.1%，机收占比超 98%。河南、江苏麦收已结束，陕西麦收进度近九成，山东过六成半，山西过半，河北过三成。

4、美国称将在乌克兰与邻国边境处建立临时储粮仓，据央视新闻，当地时间 6 月 14 日，美国总统拜登宣布将在乌克兰与邻国边境地带建造临时储粮仓，以帮助乌克兰粮食出口。拜登表示，美国正在与欧洲盟友一道，帮助转移乌克兰境内近 2000 万吨的粮食。由于海运遭到封锁，这些粮食唯有通过陆路运输才能出境。

金属市场情况

1、乌克兰扎波罗热铁矿石矿区暂停生产，据 Mysteel，6 月 13 日，受俄乌冲突影响，乌克兰扎波罗热铁矿厂暂停运营。扎波罗热铁矿厂开采世界上最好的红铁之一，铁含量超过 60%。

2、LME 有色金属现货升贴水，6 月 15 日 LME0-3 铜贴水 11.75 美元/吨，LME0-3 铝贴水 25.75 美元/吨，LME0-3 铅贴水 14 美元/吨，LME0-3 锌升水 33.25 美元/吨，LME0-3 锡升水 282.67 美元/吨，LME0-3 镍贴水 101 美元/吨。

3、6 月 15 日照港铁矿石现货报价平稳，6 月 15 日铁矿石日照港口现货报价平稳，现 PB 粉 61.5%报 960 稳，纽曼粉 62.5%报 972 稳，金布巴粉 60.5%报 894 稳，罗伊山粉 61%报 915 稳，卡粉 65%报 1154 稳，超特粉 56.5%报 810 稳（元/湿吨）。基差方面（2209 合约）：与 14 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 142。

6 月 15 日山西吕梁焦煤报价平稳，6 月 15 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 2750 元/吨。基差方面（2209 合约）：与 14 日午后收盘价对比，焦煤现货贴水 93。

6 月 15 日天津港准一级焦现货报价持稳，6 月 15 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 3510 元/吨。基差方面：与 14 日午后收盘价对比，扣除水分后，焦炭现货升水 343。

6 月 15 日国内各地热卷报价稳中偏弱, 6 月 15 日国内各地热轧卷板现货报价稳中偏弱, 现 Q235B, 4.75mm, 上海鞍钢/本钢报价 4760 稳, 北京包钢报 4760 跌 50, 广州柳钢报 4690 跌 10。基差方面：与 14 日午后收盘价对比，上海现货升水 63, 北京现货升水 63, 广州现货贴水 7。(单位：元/吨)

4、统计局：5 月中国生产原煤 3.7 亿吨，同比增长 10.3%， 据国家统计局，原煤生产保持较快增长，进口由增转降。随着煤炭保供稳价政策深入推进，原煤生产继续保持较快增长。5 月份，中国生产原煤 3.7 亿吨，同比增长 10.3%，增速比上月放缓 0.4 个百分点，日均产量 1187 万吨。进口煤炭 2055 万吨，同比下降 2.3%，上月为增长 8.5%。1—5 月份，生产原煤 18.1 亿吨，同比增长 10.4%。进口煤炭 9595 万吨，同比下降 13.6%。

5、统计局：5 月中国十种有色金属产量为 564 万吨，同比增长 3.3%， 据国家统计局，5 月有色金属冶炼和压延加工业增加值同比增加 3.4%，1-5 月累计增加值同比增长 3.9%；5 月份十种有色金属产量为 564 万吨，同比增长 3.3%，1-5 月累计产量为 2725 万吨，累计同比增长 0.9%。其中电解铝 5 月份产量为 342 万吨,同比增长 3.1%,1-5 月电解铝产量为 1640 万吨,累计同比增长 0.3%。

6、统计局：5 月中国粗钢日产 311.65 万吨，创年内新高， 国家统计局数据显示：2022 年 5 月，中国粗钢日均产量 311.65，环比增长 0.8%；生铁日均产量 259.65，环比增长 1.5%；钢材日均产量 395.52，环比增长 3.3%，均创年内新高。5 月，中国粗钢产量 9661，同比下降 3.5%；生铁产量 8049，同比增长 2.0%；钢材产量 12261，同比下降 2.3%。1-5 月，中国粗钢产量 43502，同比下降 8.7%；生铁产量 36087，同比下降 5.9%；钢材产量 54931，同比下降 5.1%。(单位：万吨)

7、统计局：中国 1-5 月水泥产量为 78348 万吨，同比下降 15.3%， 国家统计局数据显示，5 月水泥产量为 20280 万吨,同比减少 17%;1—5 月产量为 78348 万吨，同比减少 15.3%。

1、德国 5 月份 CPI 同比增长 7.9%，预估 7.9%；5 月份 CPI 环比增长 0.9%，预估 0.9%。

2、央行：2022 年一季度末我国金融业机构总资产 396.39 万亿元，据央行初步统计，2022 年一季度末，我国金融业机构总资产为 396.39 万亿元，同比增长 8.7%，其中，银行业机构总资产为 357.9 万亿元，同比增长 8.6%；证券业机构总资产为 12.81 万亿元，同比增长 18.8%；保险业机构总资产为 25.67 万亿元，同比增长 5.8%。金融业机构负债为 360.27 万亿元，同比增长 8.6%，其中，银行业机构负债为 327.66 万亿元，同比增长 8.5%；证券业机构负债为 9.77 万亿元，同比增长 20.9%；保险业机构负债为 22.85 万亿元，同比增长 6.1%。

3、美媒：拜登告诉内阁成员 他倾向于放宽特朗普时期部分对华关税，据环球网，“拜登倾向于放宽特朗普时期的一些对华关税”，美国 Axios 网站当地时间 14 日以此为题独家报道称，有知情人士爆料，美国总统拜登上周在白宫椭圆形办公室与内阁主要成员会面时表示，他倾向于从特朗普时期对中国输美产品加征关税的清单中移除一些产品。报道称，据知情人士透露，拜登是在当地时间 7 日与主要内阁成员的一次会面上表露出这一想法的，相关的正式公告预计最早将于本月发布。根据该媒体获得的消息，拜登倾向于命令美国贸易代表办公室启动一个正式的“排除程序”，以确定一些消费品（如自行车）是否应该被免除所谓的“301 关税”，但不太可能涉及钢铁、铝等大型工业产品。

4、OPEC 月报：预计 2023 年全球石油需求增速将减半，OPEC 月报预计下半年全球原油需求增长 310 万桶/日至 1.018 亿桶/日。俄乌冲突可能会减缓石油需求的反弹速度。通胀压力、病毒爆发以及俄乌冲突带来的经济影响可能会阻碍复苏。OPEC 5 月原油产量为 2846.5 万桶/日，沙特 5 月原油产量为 1041.7 万桶/日。伊朗 5 月原油产量为 253.8 万桶/日，伊拉克 5 月原油产量为 437.4 万桶/日。OPEC 预计，由于通胀和冲突影响了全球经济，明年石油需求增长速度将减半，2023 年全球石油消费量将增加 180 万桶/日，低于今年预计的 340 万桶/日。

5、美国信贷市场恐慌指数升至 2020 年以来最高水平，衡量美国信用风险的一项指标升至疫情早期以来的最高水平，突破了过去 10 年罕见的一个门槛。Markit CDX 北美投资级指数利差一度扩大 1.6 个基点，至 100.1 个基点，为 2020 年 4 月 8 日以来最高水平。

6、总统助理乌沙科夫 6 月 14 日表示，俄罗斯和乌克兰恢复谈判的问题一直没有进展。

7、俄总统助理表示，普京没有同拜登会晤的计划。

8、统计局：5 月社会消费品零售总额同比下降 6.7%，据国家统计局，5 月份，社会消费品零售总额 33547 亿元，同比下降 6.7%。其中，除汽车以外的消费品零售额 30361 亿元，下降 5.6%。1—5 月份，社会消费品零售总额 171689 亿元，同比下降 1.5%。其中，除汽车以外的消费品零售额 155095 亿元，下降 0.5%。

9、统计局：5 月份规模以上工业增加值增长 0.7%，据国家统计局，5 月份，规模以上工业增加值同比实际增长 0.7%。从环比看，5 月份，规模以上工业增加值比上月增长 5.61%。1—5 月份，规模以上工业增加值同比增长 3.3%。

10、统计局：1—5 月份全国固定资产投资同比增长 6.2%，据国家统计局，1—5 月份，全国固定资产投资（不含农户）205964 亿元，同比增长 6.2%。其中，民间固定资产投资 117128 亿元，同比增长 4.1%。从环比看，5 月份固定资产投资（不含农户）增长 0.72%。

11、统计局：1—5 月份全国房地产开发投资同比下降 4.0%，房屋新开工面积同比下降 30.6%，据国家统计局，1—5 月份，全国房地产开发投资 52134 亿元，同比下降 4.0%；其中，住宅投资 39521 亿元，下降 3.0%。1—5 月份，房屋新开工面积 51628 万平方米，同比下降 30.6%；商品房销售面积 50738 万平方米，同比下降 23.6%；商品房销售额 48337 亿元，同比下降 31.5%。房地产开发企业到位资金 60404 亿元，同比下降 25.8%。5 月末，商品房待售面积 55433 万平方米，同比增长 8.6%。

12、统计局：5 月份全国城镇调查失业率为 5.9%，16-24 岁人口调查失业率为 18.4%，据国家统计局，1-5 月份，全国城镇新增就业 529 万人。5 月份，全国

城镇调查失业率为 5.9%，比上月下降 0.2 个百分点。本地户籍人口调查失业率为 5.5%；外来户籍人口调查失业率为 6.6%，其中外来农业户籍人口调查失业率为 6.2%。16-24 岁、25-59 岁人口调查失业率分别为 18.4%、5.1%。31 个大城市城镇调查失业率为 6.9%。5 月份，全国企业就业人员周平均工作时间为 47.2 小时。

13、国家统计局：5 月份进口原油 4582 万吨，同比增长 11.8%， 据国家统计局，5 月份，进口原油 4582 万吨，同比增长 11.8%，比上月加快 5.2 个百分点。生产原油 1757 万吨，同比增长 3.6%，增速比上月放缓 0.4 个百分点，日均产量 56.7 万吨。1—5 月份，生产原油 8569 万吨，同比增长 4.1%。进口原油 21671 万吨，同比下降 1.7%。

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。