

资讯速递

金石期货研究所，2022 年 6 月 23 日

晚间收盘情况

商品期货中**涨幅前三**的品种为：焦炭 2209 涨 3.35%、铁矿石 2209 涨 2.46% 和焦煤 2209 涨 2.20%；**跌幅前三**：豆粕 2209 跌 5.54%、菜粕 2209 跌 5.12%和黄豆二号 2209 跌 5.11%。

农产品市场情况

1、贸易商转港加快，美棉成交仍占优势，据中国棉花网 6 月 21 日发布的报告，6 月份以来国内棉纺织企业、中间商询价/采购/通关的重点仍是 2020/21、2021/22 年度美棉，据海关统计，2022 年 5 月份美棉进口量占当月全国棉花进口总量的 79%，同时对 12/1/2 月船期 2022/23 年度美棉的关注度、签约有所增加。中国买家对保税棉、即期装运的兴趣越来越淡。部分外商、棉花企业向越南、印尼、印度、巴基斯坦等转港操作逐渐增多，但仍以 M 1-1/8 及以下中低品质指标的美棉/印度棉/巴西棉等为主。

2、6 月下旬南疆棉区可能出现花铃期高温热害，据新疆兴农网 6 月 22 日发布的报告，目前，北疆大部地区棉花处于蕾期，南疆部分棉花已开花，6 月下旬南疆大部棉区将进入开花普遍期，大部棉花发育期比常年提早 7 天以上。根据未来 10 天 5*5KM 格点天气预报和棉花花铃期高温热害风险等级指标及南疆棉花种植分布，预计 6 月 22~29 日，南疆大部棉区将出现不同风险程度的高温热害，其中东疆棉区、巴州大部棉区、阿拉尔棉区、图木舒克棉区为中高风险区。

3、新疆：货物出库率低于往年，纺企随行就市销售，据中国棉花网 6 月 22 日发布的报告，据库尔勒某仓库负责人介绍，今年当地棉企经营压力较大，主要是企业收购成本较高，与市场价格形成倒挂，货物周转出库率较上年度下降。目前在库数量占总入库量 43%左右。当地某纺企负责人表示，企业开工正常，纱线

产品主要以国内市场为主，原料多使用储备棉。目前，该企业原料库存在 4 个月以上，为了降低经营压力，生产的纱线多随行就市销售。

金属市场情况

1、Mysteel：5 月份进口动力煤数量环比下降 19.3%，预计 6 月份进口动力煤数量或难以大幅增加，据 Mysteel，预计 6 月份进口动力煤数量或不及往年水平。

国际市场，煤炭主产国受恶劣天气制约，供应及运输效率均有下降，叠加欧洲及印度市场用煤需求增长，海运市场现货资源紧张，对原本高位的海运煤价形成支撑。中国市场，由于新冠疫情及南方雨季持续，叠加长协保供煤炭的有序调运，中间环节及电厂被动累库，终端用户需求低迷，因此 6 月份进口动力煤数量或难以大幅增加。

2、INSG：4 月全球镍市场供应短缺缩减至 200 吨，国际镍业研究组织 (INSG) 公布的数据显示，2022 年 4 月全球镍市场供应短缺缩减至 200 吨，3 月份供应短缺为 8900 吨，2022 年 1-4 月全球镍市场供应短缺 8100 吨，而去年同期短缺 63900 吨。

3、世钢协：5 月全球粗钢产量为 1.695 亿吨，同比下降 3.5%，截至 6 月 22 日，据世界钢铁协会统计，2022 年 5 月全球粗钢产量为 1.695 亿吨，同比下降 3.5%。2022 年 5 月，中国粗钢产量为 9660 万吨，同比下降 3.5%。印度粗钢产量 1060 万吨，增长 17.3%。日本粗钢产量 810 万吨，下降 4.2%。美国粗钢产量 720 万吨，下降 2.6%。据估计，俄罗斯粗钢产量为 640 万吨，下降 1.4%。韩国粗钢产量 580 万吨，下降 1.4%。德国粗钢产量 320 万吨，下降 11.5%。土耳其粗钢产量 320 万吨，下降 1.4%。巴西粗钢产量为 300 万吨，下降 4.9%。据估计，伊朗已生产粗钢 230 万吨，下降 17.6%。

4、6 月 23 日日照港铁矿石现货报价上涨，6 月 23 日铁矿石日照港口现货报价上涨，现 PB 粉 61.5%报 785 涨 12，纽曼粉 62.5%报 797 涨 12，金布巴粉 60.5%报 724 涨 12，罗伊山粉 61%报 740 涨 12，卡粉 65%报 982 涨 12，超特粉 56.5%报 682 涨 10 (元/湿吨)。基差方面 (2209 合约)：与 22 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 143.8。

6月23日山西吕梁焦煤报价平稳, 6月23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 2800 元/吨。基差方面 (2209 合约): 与 22 日午后收盘价对比, 焦煤现货升水 508.5。

6月23日天津港准一级焦现货报价持稳, 6月23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 3210 元/吨。基差方面: 与 22 日午后收盘价对比, 扣除水分后, 焦炭现货升水 711。

6月23日国内各地热卷报价稳中偏强, 6月23日国内各地热轧卷板现货报价稳中偏强, 现 Q235B, 4.75mm, 上海鞍钢/本钢报价 4300 涨 30, 北京包钢报 4380 稳, 广州柳钢报 4230 稳。基差方面: 与 22 日午后收盘价对比, 上海现货升水 105, 北京现货升水 185, 广州现货升水 35。(单位: 元/吨)

5、LME 有色金属现货升贴水, 6月23日 LME0-3 铜升水 0.5 美元/吨, LME0-3 铝贴水 13.1 美元/吨, LME0-3 铅贴水 0.25 美元/吨, LME0-3 锌升水 160 美元/吨, LME0-3 锡升水 225 美元/吨, LME0-3 镍贴水 60 美元/吨。

6、秘鲁一社区暂停对 Las Bambas 铜矿使用道路的封锁, 据外媒 6 月 22 日报道, 秘鲁阿普里马克地区 Mara 区一社区领导周三暂停了对 MMG 的 Las Bambas 铜矿使用的高速公路的封锁, 同意与政府和公司就道路的使用进行谈, 休战将持续到下周三。如果没有找到解决方案, 社区将重新进行道路封锁。目前尚不清楚道路的封锁是否影响该矿铜精矿的运输。

宏观及化工市场情况

1、美联储主席鲍威尔表示, 美国经济非常强劲, 能够应对更紧缩的政策; 美联储坚定致力于让通胀率回到 2%; 继续加息是合适的, 决定将逐次会议作出。

2、国际能源署预计 2022 年全球能源投资将增长 8%, 当地时间 22 日, 国际能源署发布了 2022 全球能源投资报告。该报告预计 2022 年全球能源投资将增长 8%, 达到 2.4 万亿美元, 增长主要来自能源部门对清洁能源和电网的投入以及全球对提高能效的投资。预计 2022 年全球清洁能源投资将达到 1.4 万亿美元, 占到全部增长的四分之三。国际能源署也同时发出警告, 尽管全球清洁能源投资上升明显, 但目前的全球投入依然不足以实现气候变化目标。这主要是因为俄乌

冲突引起的全球能源价格上涨，以及由此引发的对煤炭供应再投资。

3、美国总统拜登支持率跌至 36%，媒体与民调机构益普索集团的最新民调结果显示，美国总统拜登的公众支持率连续第四周下跌，现已跌至 36%。分析认为，在众多受访者认为经济是美国目前面临的最重要问题的情况下，拜登的支持率受到了 40 年来最高水平的通胀影响。

媒体与民调机构益普索集团的最新民调结果显示，美国总统拜登的公众支持率连续第四周下跌，现已跌至 36%。分析认为，在众多受访者认为经济是美国目前面临的最重要问题的情况下，拜登的支持率受到了 40 年来最高水平的通胀影响。

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。