

资讯速递

金石期货研究所，2022 年 7 月 6 日

晚间收盘情况

商品期货中**涨幅前三**的品种为：铁矿石 2209 涨 1.84%、焦炭 2209 涨 1.28% 和硅铁 2209 涨 1.26%；**跌幅前三**：燃油 2209 跌 8.61%、低硫燃油 2209 跌 7.28%和棕榈油 2209 跌 7.05%。

农产品市场情况

1、预计 7 月全疆气象条件基本有利，但可能出现的高温天气对棉花花铃生长不利，据新疆兴农网 7 月 2 日发布的报告，6 月，全疆棉花现蕾、开花，部分进入开花盛期，气象条件对冬麦收晒、夏玉米播种及苗期生长、棉花蕾期生长有利，但中、下旬持续的高温天气对部分地区小麦灌浆、春玉米开花吐丝、棉花开花授粉、林果开花及幼果生长、牧草生长有不利影响，冰雹、暴雨等强对流天气使得部分地区农业生产遭受一定损失。据新疆气候中心预测：7 月全疆大部平均气温较常年偏高或特高，仅北疆北部偏低；全疆大部降水量较常年偏少或特少，仅北疆西部和南疆西部偏多。预计 7 月气象条件对全疆大部农牧业生产基本有利，但 7 月可能出现的 3 场 35℃以上的高温天气过程对棉花花铃生长、平原区春小麦灌浆及北疆春玉米开花授粉不利。

2、美国棉田旱情仍在发展，据中国棉花网 7 月 4 日发布的报告，当周，美国东南地区南部有小到中雨，棉田旱情仍在发展，东南地区北部有雷雨，旱情依然；三角洲北部高温缓解但没有降雨，苗情总体良好，现蕾偏慢；三角洲地区南部旱情继续，新棉生长顺利并稳步现蕾。得州南部大部分地区进入打顶期，得州东部苗情正常或良好，得州西部高温回落并有雷雨，但雨量整体非常稀少而且降雨来得太迟，对旱地田没有帮助，灌溉田需要更充分的降雨。西部沙漠地区有季风雨，新棉长势良好；圣约金地区天气干热，新棉已经开花，长势良好；皮马棉正在开

花结铃，新棉长势良好。

3、USDA：截止 7 月 3 日当周美棉优良率 36%，此前一周为 37%，据 USDA 作物种植生长报告，截至 2022 年 7 月 3 日当周，美国棉花优良率为 36%，去年同期为 52%，此前一周为 37%。美国棉花现蕾率为 44%，去年同期为 42%，此前一周为 33%，五年均值 44%。美国棉花结絮率为 13%，去年同期为 10%，此前一周为 8%，五年均值为 12%。

4、6 月出疆棉发运量再度回落，与 2019 年度同期基本持平。适逢新疆瓜果上市高峰期，运力较紧张，月内市场价格大幅下挫，企业运输需求有一定增加，但公铁发运量走向持续背离。

金属市场情况

1、COMEX 期铜大幅下跌，基准合约收低逾 5%，据博易大师，周二，COMEX 的铜期货大幅下跌，创下四个月来的最大单日跌幅，这也是连续第三个交易日收低。截至收盘，铜期货下跌 18.7 美分到 19.4 美分不等，成交最活跃的 2022 年 9 月期铜报收 3.415 美元/磅，较上个交易日下跌 18.9 美分或 5.24%。周二的收盘价格是 2021 年 11 月 30 日以来的最低价格。美国商品期货交易委员会(CFTC)的持仓数据显示，上周投机基金在铜期货和期权市场连续三周净做空。截至 2022 年 6 月 28 日，投机基金在 COMEX 铜期货和期权市场持有净空单 25402 手，比一周前增加 9443 手，上一周是净卖出 9164 手。

2、伦铜跌逾 4%，因经济衰退担忧持续升温，LME 铜价周二触及 19 个月以来最低，此前美元大涨，经济衰退担忧持续升温，导致资金从大宗商品市场中撤出。其他工业金属价格也触及数月最低，股市和油价均下跌。伦敦时间 7 月 5 日 17:00(北京时间 7 月 6 日 00:00)，LME 指标三个月期铜下跌 4.20%或 336 美元，收报每吨 7670 美元，为 2020 年 12 月以来最低，且为连续第四个交易日下跌。

3、Mysteel：环渤海区域累库明显，港口动力煤库存上涨，据 Mysteel，近期保供稳价政策支撑作用明显，港口多为长协保供资源，市场货源较少。前期降雨因素支撑，南方水电出力良好，火电厂等终端库存保持中高位。疫情转好后仍有零星发散，下游中小企业谨慎采购，需求低迷，询货采购不积极，市场成交较少。

上周全国港口动力煤库存整体增加，但多集中于环渤海区域。据港口动力煤库存数据显示，全国样本港口库存已连增 10 周，且超过去年同期水平（年同比增 424.3 万吨）。目前长协保供支撑作用明显，水电出力良好，下游终端库存多保持中高位，后期随夏季气温进一步升高及下游企业需求陆续释放，动力煤供需或将趋于平衡，后期需重点关注国内煤炭保供力度及迎峰度夏期间下游需求释放情况。

4、LME 有色金属现货升贴水，7 月 6 日 LME0-3 铜贴水 12.25 美元/吨，LME0-3 铝贴水 18.75 美元/吨，LME0-3 铅升水 21.25 美元/吨，LME0-3 锌升水 48.1 美元/吨，LME0-3 锡升水 205 美元/吨，LME0-3 镍贴水 71 美元/吨。

5、7 月 6 日日照港铁矿石现货报价平稳，7 月 6 日铁矿石日照港口现货报价平稳，现 PB 粉 61.5%报 801 稳，纽曼粉 62.5%报 811 稳，金布巴粉 60.5%报 756 稳，罗伊山粉 61%报 771 稳，卡粉 65%报 948 稳，超特粉 56.5%报 688 稳（元/湿吨）。基差方面（2209 合约）：与 5 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 128.2。

7 月 6 日山西吕梁焦煤报价平稳，7 月 6 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 5 日午后收盘价对比，焦煤现货升水 338。

7 月 6 日天津港准一级焦现货报价持稳，7 月 6 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 3010 元/吨。基差方面：与 5 日午后收盘价对比，扣除水分后，焦炭现货升水 464。

7 月 6 日国内各地热卷报价稳中偏弱，7 月 6 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 4270 跌 20，北京包钢报 4310 稳，广州柳钢报 4180 跌 30，基差方面：与 5 日午后收盘价对比，上海现货升水 8，北京现货升水 48，广州现货贴水 82。（单位：元/吨）

宏观及化工市场情况

1、澳洲联储将基准利率上调 50 个基点至 1.35%，符合市场预期，澳洲联储将基准利率上调 50 个基点至 1.35%，为 2019 年 5 月以来最高利率水平，符合市

市场预期。澳洲联储声明，将采取进一步措施推动货币政策正常化。预计通胀在今年晚些时候见顶，预计明年通胀率将回落至 2-3% 的区间。

2、6 月全国平均气温创 1961 年以来同期新高，新华社记者从中国气象局新闻发布会了解到，6 月全国平均气温 21.3℃，较常年同期偏高 0.9℃，为 1961 年以来同期最高；河南、陕西、甘肃、宁夏、山西、山东、江苏、安徽等地气温为历史同期最高。预计 7 月，除华南、西南地区东南部、华东南部局部气温较常年同期偏低外，全国其余地区气温接近常年同期到偏高。

3、瑞典和芬兰正式签署加入北约组织议定书，据央视新闻，当地时间 7 月 5 日，北约组织秘书长斯托尔滕贝格与芬兰外长哈维斯托及瑞典外交大臣林德在北约总部布鲁塞尔正式签署了芬瑞两国加入北约组织议定书。按照程序，这份议定书随后将交由北约现有的 30 个成员国批准。

4、俄罗斯宣布在北极地区发现 8200 万吨石油，俄罗斯能源巨头俄罗斯石油公司 Rosneft 宣布在俄罗斯西北部、位于北极地区的 Pechora Sea 发现了一个巨大的石油矿床，预估石油储量为 8200 万吨。Rosneft 在声明中表示：“在测试过程中，有最大流量为 220 立方米/日的石油可以自由流动，油是轻质、低硫、低粘度的品种。”该石油项目预计在 2024 年开始生产，预计到 2033 年，该项目将每年生产多达 1.15 亿吨石油，这相当于俄罗斯 2021 年石油总产量的 20%。据俄罗斯媒体报道称，Rosneft 公司正在北极地区推进 Vostok 项目。Igor Sechin 曾描述该项目为世界上唯一可以为油市带来稳定增量的项目。

5、英国 6 月服务业 PMI 为终值 54.3，高于预期值，英国 6 月服务业 PMI 为终值 54.3，预期为 53.4，前值为 53.4。英国 6 月综合 PMI 终值为 53.7，预期为 53.1，前值为 53.1。

6、中物联：6 月全球制造业 PMI 为 52.3%，创出年内新低，中国物流与采购联合会 7 月 6 日发布的数据显示，6 月份全球制造业 PMI 为 52.3%，较上月下降 1.2 个百分点，没有延续上月的上升趋势，且创出年内新低。二季度，全球制造业 PMI 均值为 53%，较一季度下降 1.6 个百分点。分区域看，6 月份，亚洲制造业 PMI 较上月微幅上升，欧洲、美洲和非洲制造业 PMI 较上月均有不同程

度下降，降幅均在 2 个百分点左右。

7、《华尔街日报》报道，美国总统拜登本周有意宣布对部分中国输美商品豁免加征关税，以试图降低美国创纪录的通货膨胀率。豁免仅限于服装和学习用品等商品。并计划推出允许出口商自主申请关税豁免机制。

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。