

## 资讯速递

金石期货研究所，2022年8月2日

### 晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：焦煤 2209 涨 3.70%、焦炭 2209 涨 2.11%和玻璃 2209 涨 1.80%；跌幅前三：棕榈油 2209 跌 5.97%、低硫燃油 2209 跌 4.62%和棉花 2301 跌 3.58%。

### 农产品市场情况

1、美棉合同取消增多，据中国棉花网 7 月 29 日发布的报告，7 月中旬以来买家要求取消合同、按市场价重签采购合同或协商由销售方“回购”合同的现象持续增多，包括一些常年合作的棉纺织厂、中间商老客户，合同履约率一而再再而三的下，外商也表示目前不仅中国，印度、土耳其、越南、印尼、巴基斯坦等国买家 2021/22 年度美棉合同的执行意愿都在减弱，取消前期高价合同或成为买卖双方近期博弈的焦点。

2、越南很多纺织工厂开始缺单，放假、裁员等措施随之而来，据环球纺织 8 月 1 日发布的报告，前段时间还喊招不到工人，订单满满的越南工厂，也开始缺单了。不少工厂减少加班时间、放假、裁员等措施也随之而来。经过上半年 6 个月的强劲复苏，下半年，很多工厂开始缺订单，不得不缩短生产时间，停止招聘，减少劳动力。下半年也是纺织鞋服工人企业减少订单的艰难时期。一些工厂不得不安排工人轮流休假。

3、USDA：截止 7 月 31 日当周美棉优良率 38%，此前一周为 34%，据 USDA 作物种植生长报告，截至 2022 年 7 月 31 日当周，美国棉花优良率为 38%，去年同期为 60%，此前一周为 34%。美国棉花现蕾率为 89%，去年同期为 81%，此前一周为 80%，五年均值为 87%。美国棉花结絮率为 58%，去年同期为 48%，此前一周为 48%，五年均值为 50%。

4、巴西棉区天气晴朗，利好新棉采摘。据棉花种植者协会，目前新棉总产预期下调至不足 250 万吨，较前减逾 4%。受国际棉价下挫影响，出口意向减弱。国内需求持续不见转好。

### 金属市场情况

1、Codelco 铜产量大降凸显全球矿山供应挑战，据外媒，全球最大的铜供应商 Codelco 上个季度的产量同比下降 9.3%，铜产量为 371000 吨，低于去年同期的 409000 吨。这是金属市场供应方面挑战的最新例证。由于矿石质量下降、水资

源限制和工会抗议，智利国家铜业委员会预计智利年产量将下降 3.4%。

**2、消息人士：沙特或在欧佩克会议上推动增产**，据外媒援引熟悉拜登和沙特国王会谈的消息人士的话称，沙特将在周三的欧佩克会议上推动该组织增加石油产量。消息人士称，沙特国王在 7 月 16 日与拜登总统面对面会晤时做出了这一保证。

**3、LME 有色金属现货升贴水**，8 月 2 日 LME0-3 铜升水 1.75 美元/吨，LME0-3 铝升水 14.21 美元/吨，LME0-3 铅升水 3.75 美元/吨，LME0-3 锌升水 113 美元/吨，LME0-3 锡升水 189 美元/吨，LME0-3 镍贴水 53 美元/吨。

**4、8 月 2 日照港铁矿石现货报价平稳**，8 月 2 日铁矿石日照港口现货报价平稳，现 PB 粉 61.5%报 790 稳，纽曼粉 62.5%报 805 稳，金布巴粉 60.5%报 744 稳，罗伊山粉 61%报 765 稳，卡粉 65%报 904 稳，超特粉 56.5%报 667 稳（元/湿吨）。基差方面（2209 合约）：与 1 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 71.7。

**8 月 2 日山西吕梁焦煤报价平稳**，8 月 2 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（2209 合约）：与 1 日午后收盘价对比，焦煤现货贴水 262.5。

**8 月 2 日天津港准一级焦现货报价平稳**，8 月 2 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 2410 元/吨。基差方面：与 1 日午后收盘价对比，扣除水分后，焦炭现货贴水 65。

**8 月 2 日国内各地热卷报价下跌**，8 月 2 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 4020 跌 10，北京包钢报 4130 跌 20，广州柳钢报 4030 跌 10，基差方面：与 1 日午后收盘价对比，上海现货贴水 22，北京现货升水 88，广州现货贴水 12。（单位：元/吨）

## 宏观及化工市场情况

**1、法国 7 月制造业 PMI 跌破枯荣线**，法国 7 月制造业 PMI 终值为 49.5，跌破荣枯线并创 2020 年 5 月以来新低，预期为 49.6，前值为 49.6。

**2、德国 7 月制造业 PMI 跌破枯荣线**，德国 7 月制造业 PMI 终值为 49.3，跌破荣枯线并创 2020 年 6 月以来新低，预期为 49.2，前值为 49.2。

**3、欧元区 7 月制造业 PMI 跌破枯荣线**，欧元区 7 月制造业 PMI 终值为 49.8，跌破荣枯线并创 2020 年 6 月以来新低，预期为 49.6，前值为 49.6。

**4、英国 7 月制造业 PMI 终值为 52.1，低于预期**，英国 7 月制造业 PMI 终值为 52.1，为 2020 年 6 月以来新低，预期为 52.2，前值为 52.2。

**5、欧元区 6 月失业率为 6.6%，预期 6.6%，前值 6.6%。**

**6、央行召开 2022 年下半年工作会议，强调要保持货币信贷平稳适度增长，综合运用多种货币政策工具，保持流动性合理充裕；引导金融机构增加对实体经济**

济的贷款投放，保持贷款持续平稳增长；引导实际贷款利率稳中有降；因城施策实施好差别化住房信贷政策。

7、美联储9月加息50个基点的概率为75.5%，据CME“美联储观察”：美联储到9月份加息50个基点的概率为75.5%，加息75个基点的概率为24.5%；到11月份累计加息75个基点的概率为58.6%，累计加息100个基点的概率为35.9%，累计加息125个基点的概率为5.5%。

**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。**