

资讯速递

金石期货研究所，2022 年 8 月 22 日

晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：苯乙烯 2210 涨 4.75%、硅铁 2209 涨 4.68%和沪镍 22090 涨 4.51%；跌幅前三：沥青 2212 跌 3.13%、燃油 2301 跌 2.82%和焦炭 2209 跌 2.39%。

农产品市场情况

1、ICE 期货暴涨，购销合同执行意愿明显下降，据中国棉花网 8 月 19 日发布的报告，受 7 月下旬以来，ICE 棉花期货连续大幅振荡反弹；再加上近期中国各主港保税棉、非保税棉库存呈现“双降”及预期 2022/23 年度美棉出口量将大减 200 万包，因此部分棉花企业对 6 月下旬至 7 月下旬前签约的购销合同执行意愿明显下降，或以疫情防控、高温限电等多种原因推迟履约；或要求买卖双方重新协商合同价格补签附件；或提出销售方以适当的价格回购合同。

2、吐鲁番、巴楚个别棉田已吐絮，今年新疆棉花生长进程提前 7 至 10 天，新棉上市时间将提前到 9 月中旬，吐鲁番地区棉贩零星收购手摘棉收购价 6.3 元/公斤，不具代表性。

3、近日美国主产区多地迎来降水，全美旱情区域面积有所减少，但旱情程度仍处于近年高位，结合美棉偏差率持续增加以及 USDA 大手笔下调美棉总产预期动作来看，旱情对新棉产量不利影响极为显著。

4、据统计，巴基斯坦 2022/23 财年首月 7 月纺织品服装出口额 14.81 亿美元，同比增 0.68%，环比降 13.19%；出口棉纱同比降 36.79%，环比降 22.40%；棉布同比降 12.55%，环比降 6.56%。

5、8 月 21 日，农业农村部党组召开会议，研究抗御南方高温干旱夺取秋粮丰收有关工作。会议指出，要把应对高温干旱、夺取秋粮丰收作为当前首要任务，深入分析高温热害和干旱对中晚稻、玉米等作物生长发育进程的影响，分区域分作物采取针对性抗灾救灾措施，尽最大努力减少损失，坚决打赢秋粮丰收保卫战。

6、中棉协：7 月纺企用棉成本下降，纱产量环比下降 1.3%，据中国棉花协会发布的棉纺织企业调查报告（2022 年 7 月），7 月，纺织市场延续弱势，随着原料价格下跌，纺企用棉成本下降，但采购意愿仍较弱，成品库存持续增加，部分地区高温放假开工率下降，下旬部分纺企复工复产，开工率有所回升。总的来看本月产量和上月相比下降 1.3%，同比下降 16.5%，其中：纯棉纱占比为 55.6%，较

上月增加了 0.4 个百分点；混纺纱和化纤纱占比为 44.4%，较上月下降了 0.4 个百分点。布产量环比下降了 1.7%，同比下降 14.1%，其中：纯棉布占比，较上月上升了 0.2 个百分点。纱线销售率为 71%，较上月下降 1 个百分点。当前纺织企业纱线库存 39.96 天，较上月增加 2.81 天。坯布库存 44.32 天，较上月增加 2.34 天。

7、中棉协：纺织企业用新疆棉比例增加，据中国棉花协会发布的棉纺织企业调查报告（2022 年 7 月），月内，纺织企业用新疆棉比例增加，地产棉和进口棉比例减少：1. 纺织企业使用新疆棉占总用棉量的 87.77%，较上月增加 0.92 个百分点，同比增加 0.62 个百分点，其中：储备棉占比为 6.3%，本年度新疆棉占比为 91.8%。2. 纺织企业使用地产棉比重为 3.53%，较上个月减少 0.11 个百分点。其中：储备棉占比为 9.3%，本年度地产棉占比为 87.7%。3. 纺织企业使用进口棉比重为 8.7%，较上月减少 0.81 个百分点，同比减少 0.86 个百分点。

8、中棉协：7 月底纺织企业原料库存环比减少 1.1 万吨，据中国棉花协会发布的棉纺织企业调查报告（2022 年 7 月），棉花企业销售较为积极，部分纺企利润也得到改善，但由于库存压力较大、下游订单依然疲软，并且棉价波动幅度较大，企业采购原料依然谨慎，采购量未有明显增加。截至 7 月 30 日，纺织企业在库棉花工业库存量为 57.81 万吨，较上月底减少 1.1 万吨，同比减少 26.55 万吨。其中：35%的企业减少棉花库存，19%增加库存，46%基本保持不变。

金属市场情况

1、海关总署：2022 年 7 月硅锰铁出口总量 17471.574 吨，环比上月增幅约 72.18%，根据海关数据显示，2022 年 7 月硅锰铁出口总量 17471.574 吨，环比上月增幅约 72.18%（6 月出口量 10147.124 吨），同比去年减幅约为 22.34%（去年 7 月份出口量为 22496.959 吨）。7 月出口总金额为 2858.58 万美元，环比上月增幅约 78.35%（6 月出口金额为 1602.78 万美元），同比去年减幅约为 8.16%（去年 6 月出口金额为 3112.58 万美元）。

2、海关总署：2022 年 7 月硅锰铁出口总量 17471.574 吨，环比上月增幅约 72.18%，根据海关数据显示，2022 年 7 月硅锰铁出口总量 17471.574 吨，环比上月增幅约 72.18%（6 月出口量 10147.124 吨），同比去年减幅约为 22.34%（去年 7 月份出口量为 22496.959 吨）。7 月出口总金额为 2858.58 万美元，环比上月增幅约 78.35%（6 月出口金额为 1602.78 万美元），同比去年减幅约为 8.16%（去年 6 月出口金额为 3112.58 万美元）。

3、受国内焦炭市场提降传言影响，蒙煤价格上涨后续乏力，据 Mysteel，8 月 22 日晨间蒙古国进口炼焦煤市场震荡偏强运行。受国内焦炭市场提降传言影响，蒙煤价格上涨后续乏力，通关车数稳步提升。现甘其毛都口岸：蒙 5#原煤 1570，蒙 5#精煤；策克口岸：马克 A1300，马克西 1350，欧斯克 A1000，欧斯克 A+1200，

欧斯克 B1100, 南戈壁 A1010, 南戈壁 A-900, 南戈壁 B500; 满都拉口岸: 主焦煤 1530, 1/3 焦原煤 1170; 二连浩特口岸: 蒙 5#原煤 1570; 均口岸货场提货含税现金价。19 日三大主要口岸总通关车数较上周同期增 19 车。

4、LME 有色金属现货升贴水, 8 月 22 日 LME0-3 铜升水 22.35 美元/吨, LME0-3 铝升水 7.75 美元/吨, LME0-3 铅贴水 4 美元/吨, LME0-3 锌升水 60.5 美元/吨, LME0-3 锡升水 210 美元/吨, LME0-3 镍贴水 81.5 美元/吨。

5、8 月 22 日照港铁矿石现货报价上涨, 8 月 22 日铁矿石日照港口现货报价上涨, 现 PB 粉 61.5%报 738 涨 9, 纽曼粉 62.5%报 752 涨 9, 金布巴粉 60.5%报 701 涨 9, 罗伊山粉 61%报 723 涨 9, 卡粉 65%报 854 涨 9, 超特粉 56.5%报 625 涨 7 (元/湿吨)。基差方面 (2301 合约): 与 19 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 128.7。

8 月 22 日山西吕梁焦煤报价平稳, 8 月 22 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 2020 元/吨。基差方面 (2301 合约): 与 19 日午后收盘价对比, 焦煤现货升水 148.5。

8 月 22 日天津港准一级焦现货报价平稳, 8 月 22 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 2810 元/吨。基差方面 (2209 合约): 与 19 日午后收盘价对比, 扣除水分后, 焦炭现货升水 491。

8 月 22 日国内各地热卷报价稳中偏强, 8 月 22 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 3880 涨 50, 北京包钢报 4050 稳, 广州柳钢报 4010 涨 60, 基差方面: 与 19 日午后收盘价对比, 上海现货升水 53, 北京现货升水 223, 广州现货升水 183。(单位: 元/吨)

宏观及化工市场情况

1、中国 8 月 1 年期和 5 年期以上贷款市场报价利率 (LPR) 将在今日公布, 市场预期 5 年期以上 LPR 的下调幅度或在 10bp 以上。

2、美联储主席鲍威尔本周将亮相 Jackson Hole 全球央行年会, 当地时间周五将发表讲话, 美国经济、通胀前景及政策预期表述备受关注。

3、当地时间 21 日凌晨, 莫斯科州发生一起汽车爆炸, 普京智囊杜金之女在爆炸中身亡。《华盛顿邮报》认为, 该事件似乎可能为俄乌冲突制造新的爆发点。

4、德国央行行长预计今秋通胀率或达 10%, 最近几个月来, 德国的通胀率始终保持在高位。德国央行行长阿希姆·纳格尔预计, 这一欧盟最大经济体今年秋季的通胀率可能将达到两位数。德国《莱茵邮报》20 日援引纳格尔的话报道称, 德国政府推出的能源减税和公交月票等短期补贴措施即将失效, 德国通胀率预计将再次飙升。纳格尔表示, 从整体来看, 德国秋季的几个个月通胀率可能达到 10%。

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。

42