

# 资讯速递

金石期货研究所，2022年8月26日

## 晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种（主力合约）为：硅铁 2210 涨 4.48%、焦煤 2301 涨 3.85%和铁矿石 2301 涨 3.01%；跌幅前三：菜粕 2301 跌 2.51%、沥青 2212 跌 2.46%和豆粕 2301 跌 1.90%。

## 农产品市场情况

1、7月棉纺织景气指数 45.23，较6月下降 1.34，据中棉行协 8月24日发布的报告，7月份，中国棉纺织景气指数为 45.23，较6月下降 1.34，行业持续处于欠景气状态。构成中国棉纺织景气指数的 7项分类指数均位于枯荣线下方，除产品库存指数较6月上升外，其余指数均较6月下降。

2、关注下旬低温多降水天气对棉花的不利影响，据新疆兴农网 8月23日发布的报告，目前，吐鲁番市大部棉花裂铃吐絮，北疆大部、阿克苏地区部分、喀什地区部分棉花开始裂铃吐絮，全疆其余棉区棉花处于花铃生长末期。预计下旬的降温、多降水、南疆部分地区尤其是中东部的风沙天气对北疆棉区棉花裂铃吐絮、冷凉山区春小麦成熟收获、南疆部分地区林果果实着色和成熟采摘有不利影响。

3、印度北部部分地区新棉上市，收购价格保持较高势头，据疆农助手 8月24日发布的报告，印度北部的部分地区新棉上市，与年初相比，收购价格仍然保持较高的势头，籽棉价格约为 9000-10000 卢比/公担，接近日汇率，折合人民币约为 7.740-8.860 元/公斤（1 印度卢比=0.086 人民币，1 公担=100 千克）。9 月后，印度西北部棉区的新棉将逐渐上市，后续价格存疑。

4、国家粮食和物资储备局：将与农业农村部一道，全力做好粮油收储、保供稳价等工作，据财联社，国家发展改革委党组成员，国家粮食和物资储备局党组书记、局长丛亮会见中央农办主任，农业农村部党组书记、部长唐仁健一行，就加强粮食生产流通领域合作、共同保障国家粮食安全进行深入交流。唐仁健表示，近年来，粮食和物资储备系统聚焦落实国家粮食安全战略和乡村振兴战略，提升粮食收储调控能力，全面落实粮食安全党政同责，加强粮食安全依法治理，粮食流通领域各项工作成效显著，为保障国家粮食安全提供了有力支撑。希望双方不断深化交流合作，在抓好秋粮收储、完善粮食调控体系、健全种粮农民收益保障机制、严格粮食安全责任制考核、推进粮食安全保障立法等方面加强密切协作，牢牢守住保障国家粮食安全底线。

5、菜籽油和花生期权今日上市，据郑商所，8月26日菜籽油和花生期权在郑州商品交易所上市交易。郑商所相关负责人表示，此次菜籽油和花生期权上市，与郑商所已上市的菜籽系期货、期权及花生期货共同构成了完整的风险管理工具体系，不仅能够满足产业企业多元化、精细化的风险管理需求，而且对于服务企业稳健经营和产业高质量发展具有重要意义。市场人士普遍认为，在当前市场背景下，菜籽油和花生期权将为企业期现结合业务模式创新提供更多可能，在提高套期保值精准度、降低风险对冲成本等方面发挥积极作用，进而推动产业风险管理提质增效。

## 金属市场情况

1、高温天气消退，再生铅冶炼企业限电影响暂告段落，据 SMM，近期华东区域高温酷暑天气逐渐消退，安徽和江苏区域用电负荷压力减弱，安徽太和地区再生铅冶炼企业受到的限电影响在昨天已经结束，而江苏某冶炼企业在本周暂未受到限电影响。以上企业在逐渐恢复至正常生产状态，预期恢复生产产量合计约为 1400 吨/天。

2、LME 有色金属现货升贴水，8月26日 LME0-3 铜升水 38 美元/吨，LME0-3 铝升水 10.25 美元/吨，LME0-3 铅贴水 3.56 美元/吨，LME0-3 锌升水 76.75 美元/吨，LME0-3 锡升水 175 美元/吨，LME0-3 镍贴水 99 美元/吨。

3、秘鲁下调 2022 年增长预测并放弃矿业税上调计划，据外媒，秘鲁财政部长周四表示，将该国今年的经济增长预测下调至 3.3%，并在金属价格下跌、通胀高企和增长放缓的情况下正式放弃了对采矿业加税的计划。该部在一份报告中表示，下调经济预测的原因是上半年影响第一产业的“暂时性供应冲击”，包括针对采矿业的动荡，以及不太有利的外部条件。秘鲁预计英美资源集团的 Quellaveco 铜矿将于 2023 年投产，并提振今年迄今已下降 10% 的铜产量，原因是社区抗议活动影响了 MMG 和 Southern 拥有的两个大型矿山。

4、8月26日日照港铁矿石现货报价上涨，8月26日铁矿石日照港口现货报价上涨，现 PB 粉 61.5% 报 760 涨 8，纽曼粉 62.5% 报 774 涨 8，金布巴粉 60.5% 报 723 涨 8，罗伊山粉 61% 报 745 涨 8，卡粉 65% 报 867 涨 8，超特粉 56.5% 报 647 涨 7（元/湿吨）。基差方面（2301 合约）：与 25 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 120.6。

8月26日天津港准一级焦现货报价平稳，8月26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（2301 合约）：与 25 日午后收盘价对比，扣除水分后，焦炭现货升水 622。

8月26日山西吕梁焦煤报价平稳，8月26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 25 日午后收盘价对比，焦煤现货升水 59.5。

8月26日国内各地热卷报价稳中偏强，8月26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 4000 涨 20，北京包钢报 4100 稳，广州柳钢报 4080 稳，基差方面：与 25 日午后收盘价对比，上海现货平水，北京现货升水 100，广州现货升水 80。（单位：元/吨）

## 宏观及化工市场情况

- 1、**美联储布拉德：3.75-4%是他期望的今年利率目标 对前置加息的做法更为偏好**，美联储布拉德表示，3.75-4%是他期望的今年利率目标，通货膨胀将持续更长时间，现在利率水平还不够高；债券收益率上升反映了风险的“更好定价”；前置加息在对抗通胀方面是严谨的，对前置加息的做法更为偏好。
- 2、**美国第二季度实际 GDP 年化季率较初值上修 0.3%至-0.6%；美国初请失业金人数连续第二周下降，显示就业形势强劲。**
- 3、**美联储官员齐发声，强调有必要继续加息，美联储博斯蒂克和哈克均表示尚未决定是加息 50 个基点还是 75 个基点，美联储乔治认为利率将升至 4%以上，美联储布拉德重申其今年的利率目标水平为 3.75-4%。**

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。