

资讯速递

金石期货研究所，2022 年 10 月 24 日

晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种（主力合约）为：白银 2212 涨 3.06%、国际铜 2212 涨 1.56%和沪铜 2212 涨 1.31%；跌幅前三：生猪 2301 跌 3.62%、棕榈油 2301 跌 2.27%和沪锌 2211 跌 2.14%。

农产品市场情况

1、2022/23 年度印度棉花产量或将同比增长 12%，据中棉行协海外棉纺织市场观察 202239 期，近期有报道称，在 10 月 1 日开始的 2022/23 年度，因农户扩大作物种植面积，印度棉花产量或将达到 3440 万包（170 公斤/包），较上年增加 12%，印度棉花协会（CAI）会长 Atul Ganatra 在一行业会员上表示，棉花作物的种植面积已增加约 10%，且今年每公顷单产同样可能增长。印度新年度开始时的结转库存为 319 万包，低于去年的 718 万包。新年度，印度棉花消费量可能从去年的 3180 万包增至 3200 万包，其受到低库存和高价影响。2022/23 年度出口量可能从上年的 430 万包降至 350 万包。

2、国家粮食和物资储备局：我国南方中晚稻上市，收购进度快于上年，据财联社，国家粮食和物资储备局最新发布，我国南方地区中晚稻正在陆续上市，收购进度快于上年。各地加强粮食质量安全监测，确保颗粒归仓和农民利益。截至目前，主产区累计收购中晚稻 800 万吨左右。为切实保护种粮农民利益，国家粮食和物资储备局先后批复江苏、安徽、河南三省启动中晚稻最低收购价执行预案。已安排最低收购价收储库点 330 多个、仓容 470 万吨。

3、新棉加工：截止 10 月 23 日 2022/2023 年度新疆棉累计加工 49.63 万吨，同比少 50%，据全国棉花交易市场，截止 10 月 23 日 2022/2023 年度新疆棉累计加工 49.63 万吨，较上一日增加 3.88 万吨，较去年同期减少 49.71 万吨，同比减幅 50%。

金属市场情况

1、MMG 第三季度铜总产量为 9.56 万吨，同比增加 4.8%，据我的钢铁网，MMG（五矿资源）2022 年第三季度铜总产量（阴极铜加精矿铜）为 9.56 万吨，同比增加 4.8%，环比增加 115%。Las Bambas 和 Kinsevere 实现年初至今表现最好的运营季度。现时预计 2022 年全年铜产量约为 30 万吨，较先前修订的指导范围高出 1 万吨，是由于 Las Bambas 六月生产重启后产量爬坡优于预期。于 2022 年 9 月 30 日，

Las Bambas 铜精矿含铜的库存减至大约 4.5 万吨，季内重载道路受阻减少，令铜销量达至 10.16 万吨(应付金属量)，而产量为 8.1 万吨。

2、中钢协：10 月中旬 5 大品种钢材社会库存环比下降 4.5%，10 月中旬，21 个城市 5 大品种钢材社会库存 862 万吨，环比减少 41 万吨，下降 4.5%，库存由升转降；比年初增加 74 万吨，上升 9.4%；比上年同期减少 180 万吨，下降 17.2%。

3、10 月 21 日天津港准一级焦现货报价平稳，10 月 21 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 20 日午后收盘价对比，扣除水分后，焦炭现货升水 652。

10 月 24 日山西吕梁焦煤报价平稳，10 月 24 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 2250 元/吨。基差方面（2301 合约）：与 21 日午后收盘价对比，焦煤现货升水 220。

4、统计局：三季度煤炭开采和洗选业产能利用率为 75%，黑色金属冶炼和压延加工业为 74.9%，据国家统计局，三季度，煤炭开采和洗选业产能利用率为 75.0%，化学原料和化学制品制造业为 75.3%，非金属矿物制品业为 68.2%，黑色金属冶炼和压延加工业为 74.9%，有色金属冶炼和压延加工业为 79.6%，通用设备制造业为 79.7%，专用设备制造业为 77.6%，汽车制造业为 75.7%，电气机械和器材制造业为 76.7%，计算机、通信和其他电子设备制造业为 78.1%。

5、统计局：1-9 月中国十种有色金属产量同比增长 2.8%，据国家统计局，9 月有色金属冶炼和压延加工业增加值同比增长 7.8%，1-9 月累计增加值同比增长 4.3%；9 月份十种有色金属产量为 578 万吨，同比增长 8.8%；1-9 月累计产量为 4983 万吨，累计同比增长 2.8%。其中电解铝 9 月份产量为 342 万吨，同比增长 9.3%；1-9 月电解铝产量为 2988 万吨，累计同比增长 2.8%。

6、10 月 24 日日照港铁矿石现货报价上涨，10 月 24 日铁矿石日照港口现货报价上涨，现 PB 粉 61.5%报 728 涨 12，纽曼粉 62.5%报 748 涨 12，金布巴粉 60.5%报 702 涨 12，罗伊山粉 61%报 703 涨 12，卡粉 65%报 835 涨 12，超特粉 56.5%报 632 涨 7（元/湿吨）。基差方面（2301 合约）：与 21 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 114.8。

10 月 24 日国内各地热卷报价稳中偏强，10 月 24 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 3830 涨 20，北京包钢报 3980 稳，广州柳钢报 3790 涨 10，基差方面（2301 合约）：与 21 日午后收盘价对比，上海现货升水 179，北京现货升水 329，广州现货升水 139。（单位：元/吨）

7、LME 有色金属现货升贴水，10 月 24 日 LME0-3 铜升水 95.24 美元/吨，LME0-3 铝贴水 17.5 美元/吨，LME0-3 铅升水 18 美元/吨，LME0-3 锌升水 52 美元/吨，LME0-3 锡贴水 48 美元/吨，LME0-3 镍贴水 100 美元/吨。

宏观及化工市场情况

- 1、“新美联储通讯社”：美联储可能考虑暗示缩小 12 月加息幅度，据财联社，“新美联储通讯社” NickTimiraos 发表了他的最新观点：美联储官员们正朝着再次加息 75 个基点的方向前进，以及是否会在 12 月发出小幅加息的信号。他强调了美联储内部的分歧，一些人希望放慢加息步伐，另一些人则担心通胀没有下降。
- 2、据国家统计局，9 月份，70 个大中城市中，新建商品住宅和二手住宅销售价格环比下降城市分别有 54 个和 61 个，比上月分别增加 4 个和 5 个。9 月份，一线城市新建商品住宅销售价格环比由上月上涨 0.1% 转为下降 0.1%；二手住宅销售价格环比持平。二线城市新建商品住宅和二手住宅销售价格环比分别下降 0.2% 和 0.3%，降幅均与上月相同。三线城市新建商品住宅和二手住宅销售价格环比分别下降 0.4% 和 0.5%，降幅均与上月相同。
- 3、以美元计价，中国 9 月出口同比增长 5.7%，前值为 7.1%；中国 9 月进口同比增长 0.3%，前值为 0.3%。
- 4、以人民币计价，中国 9 月出口同比增长 10.7%，前值为 11.8%；中国 9 月进口同比增长 5.2%，前值为 4.6%。
- 5、中国第三季度 GDP 同比增长 3.9%，预期增长 3.4%，前值增长 0.4%。
- 6、国家统计局：三季度就业形势有所好转，据国家统计局，今年以来，受疫情影响就业形势出现一些波动。一季度，前 2 个月就业形势总体稳定，3 月份受疫情影响，全国城镇调查失业率升至 5.8%。二季度，4 月份调查失业率继续升高至 6.1%，5 月份以后，疫情防控形势有所好转，一系列稳经济稳就业政策措施落地显效，调查失业率开始回落，6 月份降至 5.5%。进入三季度，7、8 月份城镇调查失业率继续下降，7 月份为 5.4%，8 月份为 5.3%，9 月份受疫情多发散发影响调查失业率有所上升。前三季度，城镇调查失业率均值为 5.6%，其中，三季度均值为 5.4%，比二季度下降 0.4 个百分点。从就业的主体人群看，25—59 岁劳动力失业率三季度均值为 4.4%，明显低于一季度 4.9% 和二季度 5.0% 的均值水平；本地劳动力失业率三季度均值为 5.3%，比二季度下降 0.2 个百分点。总体来看，三季度就业形势好于一季度和二季度。
- 7、海关总署：今年前三季度我国进出口同比增长 9.9%，据海关总署统计，今年前三季度，我国进出口总值 31.11 万亿元人民币，比去年同期（下同）增长 9.9%。其中，出口 17.67 万亿元，增长 13.8%；进口 13.44 万亿元，增长 5.2%；贸易顺差 4.23 万亿元，扩大 53.7%。按美元计价，前三季度我国进出口总值 4.75 万亿美元，增长 8.7%。其中，出口 2.7 万亿美元，增长 12.5%；进口 2.05 万亿美元，增长 4.1%；贸易顺差 6451.5 亿美元，扩大 51.6%。
- 8、国家统计局：前三季度全国居民人均可支配收入实际增长 3.2%，国家统计局公布数据，前三季度，全国居民人均可支配收入 27650 元，比上年同期名义增长 5.3%，扣除价格因素，实际增长 3.2%。分城乡看，城镇居民人均可支配收入 37482 元，增长（以下如无特别说明，均为同比名义增长）4.3%，扣除价格因素，实际

增长 2.3%；农村居民人均可支配收入 14600 元，增长 6.4%，扣除价格因素，实际增长 4.3%。

9、国家统计局：三季度全国工业产能利用率为 75.6%，季环比回升 0.5%，据国家统计局，三季度，全国工业产能利用率为 75.6%，比上年同期下降 1.5 个百分点，比上季度回升 0.5 个百分点。

10、国家统计局：2022 年 1—9 月份全国固定资产投资（不含农户）增长 5.9%，据国家统计局，1—9 月份，全国固定资产投资（不含农户）421412 亿元，同比增长 5.9%。其中，民间固定资产投资 232043 亿元，同比增长 2.0%。从环比看，9 月份固定资产投资（不含农户）增长 0.53%。

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。