

资讯速递

金石期货研究所，2022 年 10 月 27 日

晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种（主力合约）为：黄豆二号 2212 涨 2.42%、燃油 2301 涨 1.73%和国际铜 2301 涨 1.47%；跌幅前三：铁矿石 2301 跌 4.10%、苯乙烯 2212 跌 3.05%和乙二醇 2301 跌 2.35%。

农产品市场情况

1、中棉协：截至 10 月 23 日，全国皮棉累计加工量同比减少 49.88%，据中国棉花协会发布的全国棉花收购加工周报，截止到 2022 年 10 月 23 日，全国皮棉累计加工量 50.25 万吨，同比减幅 49.88%。新疆地区皮棉累计加工总量 49.63 万吨，同比减幅 50%，其中：自治区皮棉加工量 27.78 万吨，同比减幅 49.1%；兵团皮棉加工量 21.85 万吨，同比减幅 51.1%。内地加工量为 6128.91 吨，同比减少 32.6%，其中山东为 3834.77 吨，同比减幅 49.8%，甘肃省为 1439 吨，同比增加 27.7%，河北省 659.24 吨，较去年同期大幅增加，湖北为 195.89 吨，同比减幅 4.8%。

2、中棉协：10 月 17 日至 10 月 23 日全国籽棉平均收购价环比上涨 6%，据中国棉花协会发布的全国棉花收购加工周报，2022 年全国棉花价格仍未能突破去年同期。据统计，本周全国籽棉平均收购价为 6.6 元/公斤，同比下跌 38.2%，环比上涨 6%；新疆籽棉平均收购价为 5.87 元/公斤，同比下跌 45%，环比上涨 2.8%，其中手摘棉平均价格为 7.09 元/公斤，同比下跌 37.9%，环比上涨 0.8%；机采棉平均价格为 5.86 元/公斤，同比下跌 44.6%，环比上涨 4.9%；内地棉平均价格为 7.93 元/公斤，同比下跌 19.6%，环比上涨 0.8%。

3、中棉协：近期内地皮棉价格持续上涨，据中国棉花协会，近期内地皮棉价格持续上涨，主要是新疆疫情形势严峻，运量降低，运价上涨，而地产棉产区与消费地更近，交通便利，运费相对低廉，使内地棉处在相对有利的位置。另外，由于今年内地降水偏少，棉花品质高于预期，对于新疆棉产生了部分可替代性。

4、新棉加工：截止 10 月 26 日 2022/2023 年度新疆棉累计加工 61.94 万吨，同比少 47.7%，据全国棉花交易市场，截止 10 月 26 日 2022/2023 年度新疆棉累计加工 61.94 万吨，较上一日增加 4.27 万吨，较去年同期减少 56.46 万吨，同比减幅 47.7%。

5、农业农村部：生猪生产形势总体较好，后期生猪价格不具备持续上涨基础，农业农村部表示，当前生猪生产形势总体较好，市场供应有保障。前三季度全国生猪出栏 5.2 亿头，同比增长 5.8%；猪肉产量 4150 万吨，同比增长 5.9%。对于近期全国生猪和猪肉价格出现上涨，农业农村部畜牧兽医局副局长辛国昌表示，短期上涨主要是季节性和阶段性的，这两天在回落，现在生猪产能非常充足，能繁母猪存栏、生猪存栏和新出生仔猪量都是连续 5 个月增长，后期价格不具备持续上涨的基础。

金属市场情况

1、国家统计局：9月中国电解铝产量342.1万吨，同比增9.3%，据国家统计局，2022年9月中国氧化铝产量705.2万吨，同比增长7.5%；1-9月累计产量6147.1万吨，同比增长4.4%。9月电解铝产量342.1万吨，同比增长9.3%；1-9月累计产量2987.5万吨，同比增长2.8%。9月铝材产量543.2万吨，同比增长2.6%；1-9月累计产量4571.3万吨，同比下降0.9%。9月铝合金产量109.8万吨，同比增长24.1%；1-9月累计产量906.2万吨，同比增长15.6%。

2、国家统计局：9月精炼铜产量94.6万吨，同比增长5.8%，据国家统计局，2022年9月中国铜材产量222.1万吨，同比增长9.5%；1-9月累计产量1636.6万吨，同比下降0.5%。9月精炼铜（电解铜）产量94.6万吨，同比增长5.8%；1-9月累计产量806.3万吨，同比增长2.9%。

3、国家统计局：9月中国铅产量67.2万吨，同比增10.9%，据国家统计局，2022年9月铅产量67.2万吨，同比增长10.9%；1-9月铅产量累计值556.6万吨，累计同比增长4.7%。

4、国家统计局：9月中国锌产量58.3万吨，同比增长3.7%，据国家统计局，2022年9月锌产量58.3万吨，同比增长3.7%；1-9月锌产量累计值498.7万吨，累计同比下降0.1%。

5、钢材市场情绪偏弱，西北联钢发布行业倡议书，西北联合钢铁各股东企业同时也是陕西市场主要建筑钢材流通品牌日前发布《倡议书》，并对其中提到的“按需组织生产，维护供需平衡”做出表率。按照西北联钢股东钢企安排减产情况，6家钢企铁水日均减少产量2.8-3.1万吨，以及后续的秋冬季减产，整体区域内供应将收缩。

6、LME有色金属现货升贴水，10月27日LME0-3铜升水94美元/吨，LME0-3铝贴水4美元/吨，LME0-3铅升水9.75美元/吨，LME0-3锌升水40美元/吨，LME0-3锡升水29美元/吨，LME0-3镍贴水111美元/吨。

7、10月27日日照港铁矿石现货报价平稳，10月27日铁矿石日照港口现货报价平稳，现PB粉61.5%报702稳，纽曼粉62.5%报721稳，金布巴粉60.5%报672稳，罗伊山粉61%报677稳，卡粉65%报804稳，超特粉56.5%报605稳（元/湿吨）。基差方面（2301合约）：与26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100.5。

10月27日山西吕梁焦煤报价平稳，10月27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2350元/吨。基差方面（2301合约）：与26日午后收盘价对比，焦煤现货升水392.5。

10月27日天津港准一级焦现货报价平稳，10月27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26日午后收盘价对比，扣除水分后，焦炭现货升水694。

宏观及化工市场情况

1、至少10城首套房贷利率进入“3时代”，据澎湃新闻，10月20日，人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布：1年期LPR为3.65%，5年期以上LPR为4.3%，均与上月持平。自8月份降息以来，贷款市场报价利率（LPR）已连续2个月按兵不动。拉长时间线看，今年以来，5年期以上LPR已经下调3次，累计下降35个基点，首套房贷利率下限降至4.1%，二套房贷利率下限为4.9%。尽管10月贷款市场报价利率（LPR）保持不变，但对于首套房贷利率而言，部分特定城市的首套房贷利率正进一步下调，已有超10个城市首套房贷利率进入了“3时代”。

2、据美国抵押贷款银行协会（MBA），美国30年期固定抵押贷款利率20年来首次突破7%。

3、美国9月新建住宅销量折合年率603000套，预估为580000套。

4、国家统计局：1—9 月份全国规模以上工业企业利润下降 2.3%，国家统计局数据显示，1—9 月份，全国规模以上工业企业实现利润总额 62441.8 亿元，同比下降 2.3%。1—9 月份，规模以上工业企业中，国有控股企业实现利润总额 20947.9 亿元，同比增长 3.8%；股份制企业实现利润总额 45593.4 亿元，下降 0.4%；外商及港澳台商投资企业实现利润总额 14814.5 亿元，下降 9.3%；私营企业实现利润总额 17005.0 亿元，下降 8.1%。

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。