

资讯速递

金石期货研究所，2023 年 6 月 9 日

晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：铁矿石 2309 涨 3.44%、纸浆 2309 涨 3.42%和沪锡 2307 涨 3.39%；跌幅前三：乙二醇 2309 跌 2.39%、沥青 2308 跌 1.80%和低硫燃油 2309 跌 1.56%。

农产品市场情况

1、1-4 月我国规模以上纺织工业增加值同比下降 3.3%，据中纺联产业经济研究院，国家统计局数据显示，2023 年 1-4 月，我国规模以上纺织工业增加值同比下降 3.3%，增速较上年同期回落 5.6 个百分点。

2、1-4 月我国规模以上纺织企业营业收入同比下降 5.6%，据中纺联产业经济研究院，国家统计局数据显示，2023 年 1-4 月我国规模以上纺织企业营业收入同比下降 5.6%，利润总额同比下降 31%。

3、美国中西部局部地区将迎来降雨，气温大多偏低，据外媒报道，美国中西部农业主产区气象预报信息显示，西部周四局部有阵雨。周五天气大多干燥。周六至周日有分散性阵雨。周六前气温接近至高于正常水平。周日气温接近正常水平。东部周四至周六天气大多干燥。周日有分散性阵雨。周五前气温接近至低于正常水平。周六气温接近至高于正常水平。周日气温接近至低于正常水平。一股锋面未来几日将在南部形成，令气温下滑并给西部地区带来局部阵雨。另一股锋面将在周末形成，带来更多分散性降雨，但并不是所有地区都会迎来降雨。然而，这仍将是数周来东部地区迎来大范围降雨的最佳机会。该天气模式将在下周对干燥地区有利。

4、北方高温持续 新疆局地最高温超 40℃，中央气象台预计，未来几天，西北至华北、黄淮一带仍有高温天气，其中新疆受大陆高压影响，不少地方可能出现连续 5—6 天 35℃以上的高温天气，局地最高气温可达 40℃以上。而处在西北气流控制下的华北、黄淮一带，白天阳光炙烤大地，紫外线强烈，北京、天津、河北、河南、山东等部分地区今明天也将出现高温。后天，随着高温范围向南扩展，湖北、安徽、江苏等地部分地区也将加入高温行列。气象部门提醒大家持续做好防暑降温措施。

5、USDA:截至 6 月 1 日当周 2022/2023 年度美国陆地棉出口净销售 48.04 万包,比前一周增长 79%, 据 USDA 最新数据, 截止 6 月 1 日当周, 2022/2023 年度陆地棉净销售 480400 包, 创市场年度新高, 比前一周增长 79%, 明显高于前 4 周的平均水平。增加主要是中国 (384700 包)、巴基斯坦 (51600 包)、土耳其 (18800 包)、孟加拉国 (13300 包) 和越南 (6500 包), 韩国 (-2400 包) 和危地马拉 (-2000 包)。2023/2024 年度陆地棉净销售为 30800 包, 主要来自土耳其 (20700 包)、秘鲁 (4000 包)、危地马拉 (2700 包)、中国 (2200 包) 和印度尼西亚 (900 包)。周度出口装船量 317000 包, 比前一周上涨 12%, 比前 4 周平均上涨 4%。目的地主要是土耳其 (89500 包)、越南 (75800 包)、巴基斯坦 (33700 包)、中国 (32700 包) 和墨西哥 (16100 包)。2022/2023 年皮马棉的净销售额总计 2100 包, 比前一周下降 43%, 比前 4 周平均水平下降 71%。增长主要来自越南 (900 包) 和印度 (900 包)。周度出口装船量 11700 包, 比前一周下降 56%, 比前 4 周平均水平下降 35%。目的地是印度 (8200 包)、越南 (1300 包)、孟加拉国 (900 包)、巴基斯坦 (900 包) 和土耳其 (400 包)。

6、美棉 ON-call: 截止 6 月 2 日当周美棉 7 月末点价主力卖出合约较上周减少,据 CFTC, 截至 2023 年 6 月 2 日当周, 美棉 ON-call 未点价卖出合约 61167(+115) 张, 其中 7 月末点价主力卖出合约 20737(-1027) 张, 未点价买入合约 7966(-1687) 张, 总持仓 200700 (+5726) 张。

7、新疆棉花汽运出库小幅回升,据中国棉花网, 据阿克苏、喀什、奎屯等地几家棉花监管仓库反馈, 6 月上旬以来皮棉汽运出库量较 5 月下旬有所回升, 重点流向是江苏、山东、河南、湖北等主消费区, 以棉花贸易商/期现公司发运为主 (含为内地棉纺织企业代发运), 大中型棉纺织企业对铁路运输依旧“情有独钟”。从调查来看, 由于 5-6 月份出疆车辆不充足、油价持续震荡及铁路运输的比价效应, 汽运费用企稳。另外, 新疆内外棉花价差仅 400-500 元/吨, 也使运费调整空间不大。

金属市场情况

1、六月铁矿石需求压力仍存, 铁矿石价格或先涨后跌,据 Mysteel, 整体来看, 6 月份铁矿石基本面或将呈现供强需弱的格局, 供应端在矿山季末冲量的季节性规律下, 铁矿石供应量将会由较大增量; 对于铁矿石需求而言, 6 月份钢厂将会承受下游淡季压力以及市场可能的政策性减产压力, 铁矿石需求下降概率较大, 库存或将出现连续性的累库。六月份铁矿石价格走势或将呈现出先涨后跌趋势, 并且跌幅要大于上旬涨幅。六月份前期铁矿石价格在高位需求支撑下震荡盘整, 阶段性受到人民币贬值有所抬升; 月中旬之后或将受到钢厂市场化减产或者可能的政策性限产, 导致铁矿石需求大幅下滑, 从而带动铁矿石价格持续下跌。除此

之外，钢厂淡季的负反馈或加大铁矿石价格的跌幅，不过也需要注意，现阶段废铁价差的持续收窄以及主流 MNPJ 持续期去库对铁矿石价格的边际支撑作用。

2、全国主流市场不锈钢 78 仓库口径社会总库存 99 万吨，周环比下降 3.45%，据 Mysteel，截至 6 月 8 日，全国主流市场不锈钢 78 仓库口径社会总库存 99 万吨，周环比下降 3.45%。其中冷轧不锈钢库存总量 49.47 万吨，周环比下降 5.89%，热轧不锈钢库存总量 49.53 万吨，周环比下降 0.87%。本期全国主流市场不锈钢 78 仓库口径社会总库存呈现五连降，本周期货盘面上涨，带动市场氛围转活跃，部分下游入市提货，加之周内市场到货仍保持低位水平，因此全国不锈钢社会库存依旧消化为主。

3、智利法院延长 Lundin 铜矿关闭期限，据外媒，智利一家环境法庭周四发出停工令，将阻止加拿大矿业公司 Lundin 重新开放其 Alcaparrosa 铜矿。近一年前附近一个村庄出现一个巨大的天坑，Lundin 关闭该铜矿。环境法院表示，临时停工是应政府机构 CDE 的要求，CDE 已向法院提起诉讼。停工可能会持续到审判结束。CDE 诉讼指控 Lundin 及其子公司在智利北部 Tierra Amarilla 村造成 118 英尺宽 (36 米宽) 的天坑，造成环境破坏。

4、Mysteel：全国 18 港焦炭库存环比减 3.5 万吨，全国 16 港进口焦煤库存环比减 17.4 万吨，本周 Mysteel 统计全国 18 个港口焦炭库存为 233.3 减 3.5；其中北方 5 港焦炭库存为 40.3 减 0.9，华东 10 港 179.0 减 2.0，南方 3 港 14.0 减 0.6。本周 Mysteel 统计全国 16 个港口进口焦煤库存为 501.3 减 17.4；其中华北 3 港焦煤库存为 134.0 增 1.9，东北 2 港 53.6 减 8.7，华东 9 港 217.7 增 18.4，华南 2 港 96.0 减 29.0。（单位：万吨）

5、LME 有色金属现货升贴水，6 月 9 日 LME0-3 铜贴水 11.5 美元/吨，LME0-3 铝贴水 39 美元/吨，LME0-3 铅升水 14.5 美元/吨，LME0-3 锌贴水 1.5 美元/吨，LME0-3 锡升水 427 美元/吨，LME0-3 镍贴水 121 美元/吨。

宏观及化工市场情况

1、CME “美联储观察”：美联储 6 月维持利率不变的概率为 71.3%，据 CME “美联储观察”：美联储 6 月维持利率不变的概率为 71.3%，加息 25 个基点的概率为 28.7%；到 7 月维持利率在当前水平的概率为 34.2%，累计加息 25 个基点的概率为 50.9%，累计加息 50 个基点的概率为 14.9%。

2、乘联会：5 月新能源车市场零售 58 万辆，环比增长 10.5%，据乘联会，5 月新能源乘用车批发销量达到 67.3 万辆，同比增长 59.4%，环比增长 11.5%。今年以来累计批发 277.8 万辆，同比增长 46.5%。5 月新能源车市场零售 58.0 万辆，同比增长 60.9%，环比增长 10.5%。今年以来累计零售 242.1 万辆，同比增长 41.1%。

3、俄副总理：2022 年俄罗斯液化天然气对华出口量增长 35.2%至 600 万吨，俄罗斯副总理诺瓦克发表署名文章称，2022 年俄罗斯液化天然气对华出口量增长

35.2%，增至 600 万吨，管道天然气对华出口量增长 0.5 倍，增至 154 亿立方米。向中国出口的电能为 47 亿千瓦时，创造新高。诺瓦克表示，2023 年将继续扩大管道天然气对华出口量，计划将出口量增至 220 亿立方米，即增加 43%。

4、美国上周首申失业金人数超预期升至 26.1 万人，创 2021 年 10 月以来最高，前值为 23.3，单周涨幅创近两年最大。金融市场对美联储下周暂停加息的预期随之升温。

5、中国 5 月 PPI 同比下降 4.6%，国家统计局数据显示，2023 年 5 月份，全国工业生产者出厂价格同比下降 4.6%，环比下降 0.9%；工业生产者购进价格同比下降 5.3%，环比下降 1.1%。1—5 月平均，工业生产者出厂价格比去年同期下降 2.6%，工业生产者购进价格下降 2.3%。

6、中国 5 月 CPI 同比上升 0.2%，国家统计局数据显示，2023 年 5 月份，全国居民消费价格同比上涨 0.2%。其中，城市上涨 0.2%，农村上涨 0.1%；食品价格上涨 1.0%，非食品价格持平；消费品价格下降 0.3%，服务价格上涨 0.9%。1—5 月平均，全国居民消费价格比上年同期上涨 0.8%。

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。