

午间资讯速递

金石期货研究所，2023年6月14日

午间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：沪镍 2307 涨 5.86%、玻璃 2309 涨 5.61%和纯碱 2309 涨 5.08%；跌幅前三：鸡蛋 2309 跌 0.42%、白银 2308 跌 0.27%和黄金 2308 跌 0.24%。

农产品市场情况

1、棉花进入第五真叶期，部分现蕾，据新疆兴农网，6月上旬，气温全疆大部偏高，克州大部、和田地区大部偏低；降水全疆大部偏少，南疆西部部分偏多；日照北疆和东疆偏多、南疆大部偏少。旬内，北疆部分、巴州部分、阿克苏地区部分冬麦乳熟，喀什地区大部冬麦成熟；平原区大部春麦抽穗，部分开花，冷凉区春麦拔节；春玉米进入七叶期，部分拔节；棉花进入第五真叶期，部分现蕾。本旬气象条件对喜温作物苗期生长有利，但持续高温天气对小麦灌浆、红枣开花坐果有不利影响。

2、6月中旬前期南疆持续高温天气对灌浆期小麦灌浆、红枣开花坐果不利，据新疆兴农网，据自治区气象台预报：6月中旬，旬平均气温南疆大部偏高，北疆略偏低；北疆前中期（17日之前）偏冷，后期（17-20日）偏暖；旬降水量伊犁州、博州、天山山区、南疆西部山区偏多，全疆其余大部偏少。11日白天（南疆东疆持续到15日），全疆平原大部将出现35℃以上的高温天气，天山北坡、南疆大部、东疆和博州、阿勒泰地区等地的部分区域最高气温将升至37℃以上，其中天山北坡、巴州南部、吐鲁番市、哈密市等地的部分区域将达40℃以上，吐鲁番市部分区域达45℃以上。11日午后到13日白天，北疆大部、南疆西部山区、巴州南部山区、哈密市北部等地的部分区域有微到小雨，北疆西部北部、天山山区的部分区域有中到大雨，伊犁州、博州、塔城地区北部、阿勒泰北部的

山区局地暴雨；气温有些下降，高温天气缓解。12 日夜间到 13 日白天，南疆盆地中东部有 5 级左右偏东风，并伴有扬沙或沙尘天气。14 日白天到 16 日，伊犁州、博州、天山山区和南疆西部山区、阿克苏地区北部、巴州北部、昆仑山北坡等地的部分区域有微到小雨，其中伊犁州、天山山区、昆仑山北坡等地的部分区域有中到大雨，伊犁州、天山山区、阿克苏北部山区、巴州山区局地有暴雨。17 日到 19 日，全疆平原大部有一次短暂的高温天气。预计中旬前期南疆持续高温天气对灌浆期小麦灌浆、红枣开花坐果，17 日到 19 日高温对北疆小麦灌浆有不利影响。

3、农业农村部：本月对 2023/24 年度中国棉花供需形势预测与上月保持一致，据农业农村部发布 2023 年 5 月中国农产品供需形势分析，本月对 2023/24 年度中国棉花供需形势预测与上月保持一致。当前，新疆棉花处于第五真叶至现蕾期，黄河流域和长江流域大部处于第三到第五真叶期，主产区大部气象条件基本有利；新疆棉区发育期较常年偏晚，其余产区接近常年，后期将持续关注气候对棉花单产的影响。

4、5 月下旬中国签约 2022/23 年度美棉大增，据中国棉花网，据 USDA 出口周报统计，2023 年 5 月 12-18 日一周、5 月 19-25 日一周、5 月 26 日-6 月 1 日一周中国分别净签约 2022/23 年度美国陆地棉 1.47 万吨、5.03 万吨、8.72 万吨，分别占当周美陆地棉签约出口总量的 49.33%、82.87%、80%，进口量、进口占比较 5 月中旬不断创下本年度中国签约量的新高。

5、近期中国企业签约 2022/23 年度美棉积极性大幅回升，据中国棉花网，为何近期中国企业签约 2022/23 年度美棉积极性大幅回升呢？业内分析主要有如下几点：一是美棉价格优势全面显现。5 月下旬以来，ICE 棉花期货 12 月合约跌破 80 美分/磅、79 美分/磅，内外棉花价差一度扩大至 1500-2000 元/吨（1% 关税下）。二是部分有棉花进口配额的规模以上企业提前布局 2023/24 年度原料供应。考虑到 2023 年全国/新疆地区不仅植棉面积整体降幅较大，而且受天气因素影响新疆南疆三大棉区单产有可能下降及新疆地区下年度提价抢收的概率

大幅上升,因此手握 1%关税配额的用棉企业对远月美棉船货的询价、下单增多。

三是人民币继续贬值担忧加剧,企业通过等多种方式降低棉花进口风险。

6、中棉协:天气不利棉花生产,苗情长势差于去年,2023年5月,中国棉花协会棉农分会对全国10个省市和新疆自治区1745个定点农户进行了棉花播种进度及生长情况的调查,调查结果显示:全国大部棉区气温偏低,苗情整体差于去年,发育偏晚,六成棉花仍处于第4-5真叶期。

7、中棉协:截至5月底全国棉花播(栽)种工作基本完成,2023年5月,中国棉花协会棉农分会对全国10个省市和新疆自治区1745个定点农户进行了棉花播种进度及生长情况的调查,调查结果显示:截至5月31日,全国棉花播(栽)种工作基本完成,播(栽)种进度达99.6%,较去年慢0.1个百分点,其中新疆播种全部完成;黄河流域为99.9%,较去年慢0.1个百分点;长江流域播(栽)种进度达到91.7%,较去年慢4.2个百分点。

8、新疆天气对棉花有利,据中国棉花协会发布的每周快报,6月上旬,全国棉花进入第五真叶期。新疆棉区多晴好天气,整体利于棉花生长,大部气温上升快,降水偏少,新棉长势普遍较好。预计6月中旬,新疆平均气温南疆大部偏高,北疆略偏低,降水量偏少,基本利于棉花生长,棉区应根据土壤墒情及时灌头水,并做好棉田追肥化控工作。

金属市场情况

1、央行:5月份人民币存款增加1.46万亿元 同比少增1.58万亿元,央行数据显示,5月份人民币存款增加1.46万亿元,同比少增1.58万亿元。其中,住户存款增加5364亿元,非金融企业存款减少1393亿元,财政性存款增加2369亿元,非银行业金融机构存款增加3221亿元。5月末,本外币存款余额280.94万亿元,同比增长11.1%。人民币存款余额274.91万亿元,同比增长11.6%,增速比上月末低0.8个百分点,比上年同期高1.1个百分点。5月末,外币存款余额8518亿美元,同比下降13.5%。5月份外币存款减少301亿美元,同比多减171亿美元。

2、LME 有色金属现货升贴水, 6月14日LME0-3铜贴水 10 美元/吨, LME0-3铝贴水 37.75 美元/吨, LME0-3 铅升水 31 美元/吨, LME0-3 锌升水 2 美元/吨, LME0-3 锡升水 456 美元/吨, LME0-3 镍贴水 72 美元/吨。

3、俄罗斯铝库存在 LME 仓库占比大增, 提振对印度替代品的需求, 据外媒, 周一交易所网站数据显示, 5月俄罗斯铝库存在伦敦金属交易所 (LME) 注册仓库中的占比从4月的52%跳增至68%, 交易商报告对印度金属作为替代品的需求增加。5月在LME仓库中的俄罗斯铝库存总计为263125吨, 而印度产地铝占比总计为30%, 或116800吨, 4月为46.5%。

宏观及化工市场情况

1、中国5月社会融资规模增量15600亿元, 预估为19000亿元, 前值为12171亿元; 中国5月货币供应量M2同比增长11.6%, 预估为12.0%, 前值为12.4%; 中国5月新增人民币贷款13600亿, 预估为15500亿元, 前值为7188亿元。

2、央行: 5月份人民币存款增加1.46万亿元 同比少增1.58万亿元, 央行数据显示, 5月份人民币存款增加1.46万亿元, 同比少增1.58万亿元。其中, 住户存款增加5364亿元, 非金融企业存款减少1393亿元, 财政性存款增加2369亿元, 非银行业金融机构存款增加3221亿元。5月末, 本外币存款余额280.94万亿元, 同比增长11.1%。人民币存款余额274.91万亿元, 同比增长11.6%, 增速比上月末低0.8个百分点, 比上年同期高1.1个百分点。5月末, 外币存款余额8518亿美元, 同比下降13.5%。5月份外币存款减少301亿美元, 同比多减171亿美元。

3、欧佩克月报显示, 2023年全球石油需求增速预期维持在235万桶/日, 此前预测为233万桶/日。OPEC表示, 由于自愿减产, 5月该组织石油产量下降46.4万桶/日至2,806万桶/日。

4、美国5月CPI同比上升4%, 预估为4.1%, 前值为4.9%; 5月CPI环比上升0.1%, 预估为0.1%, 前值为0.4%。

5、美国能源部称，美国 2023 年将购买大约 1200 万桶石油，用于回填战略石油储备 (SPR)；这包括之前全部的 8-9 月购买计划；将继续寻找购买更多石油的机会。

6、CME “美联储观察”：美联储 6 月维持利率不变的概率升至 93.1%， 据 CME

“美联储观察”：美联储 6 月议息会议维持利率不变的概率为 93.1%，加息 25 个基点的概率为 6.9%；到 7 月维持利率在当前水平的概率为 35.4%，累计加息 25 个基点的概率为 60.3%，累计加息 50 个基点的概率为 4.3%。

7、世界银行预计 2023 年中国 GDP 增长 5.6%， 世界银行 14 日发布了最新一期《中国经济简报》。报告指出，随着服务支出的激增，2023 年一季度中国经济活动有所反弹。在消费需求反弹的带动下，预计 2023 年中国 GDP 将增长 5.6%。基础设施和制造业的投资预计将保持韧性。

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。