

午间资讯速递

金石期货研究所，2023年6月16日

午间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：棕榈油 2309 涨 6.09%、黄豆二号 2308 涨 5.30% 和豆油 2309 涨 5.03%；跌幅前三：玻璃 2309 跌 0.24%、生猪 2309 跌 0.18% 和白糖 2309 跌 0.16%。

农产品市场情况

1、USDA：截至 6 月 8 日当周 2022/2023 年度美国陆地棉出口净销售 9.89 万包，比前一周下降 79%，据 USDA 最新数据，截止 6 月 8 日当周，2022/2023 年的净销售额为 98900 包，比前一周下降 79%，比前 4 周的平均水平下降 61%。增加主要为中国（70500 包）、孟加拉国（11700 包）、越南（9900 包）、印度尼西亚（4500 包），巴基斯坦（-500 包）。2023/2024 年度陆地棉净销售为 65700 包，主要来自中国（63800 包）和土耳其（1800 包）。周度出口装船量 244800 包，比前一周下降 23%，比前 4 周平均水平下降 19%。目的地主要是土耳其（64000 包）、越南（39100 包）、巴基斯坦（38000 包）、中国（25400 包）、和孟加拉国（16400 包）。2022/2023 年皮马棉的净销售额总计 2000 包，比前一周下降 4%，比前 4 周平均水平下降 48%。主要是埃及（1300 包）、巴基斯坦（400 包）和巴西（200 包），哥伦比亚（-100 包）。周度出口装船量 300 包，比前一周和前 4 周的平均水平下降了 98%。目的地是印度（200 包）和中国（100 包）。

2、美棉 ON-call：截止 6 月 9 日当周美棉 12 月未点价主力卖出合约较上周增加，据 CFTC，截至 2023 年 6 月 9 日当周，美棉 ON-call 未点价卖出合约 61322（+155）张，其中 12 月未点价主力卖出合约 33097（+6063）张，未点价买入合约 32783（+2977）张，总持仓 178493（-22207）张。

金属市场情况

1、全国主流市场不锈钢 78 仓库口径社会总库存 98.22 万吨,周环比下降 0.78%,

据 Mysteel,截至 6 月 15 日,全国主流市场不锈钢 78 仓库口径社会总库存 98.22 万吨,周环比下降 0.78%。其中冷轧不锈钢库存总量 47.49 万吨,周环比下降 4.00%,热轧不锈钢库存总量 50.74 万吨,周环比上升 2.43%。本期全国主流市场不锈钢 78 仓库口径社会总库存去库速度有所放缓,主要以 200 系及 400 系资源消化为主。本周整体出货一般,市场反馈到货依旧偏少,少部分资源甚至出现断货情况,因此全国不锈钢社会库存依旧呈现降量。

2、LME 有色金属现货升贴水,6 月 16 日 LME0-3 铜贴水 2.01 美元/吨,LME0-3

铝贴水 36.75 美元/吨, LME0-3 铅升水 31 美元/吨, LME0-3 锌平水美元/吨, LME0-3 锡升水 1434.5 美元/吨, LME0-3 镍贴水 92 美元/吨。

3、Mysteel: 五大钢材基本面转为供增库降趋势, 预计下周整体现货价格窄幅

盘整, 据 Mysteel, 整体基本面维持供需负差, 但供应水平有逐步回升势头, 从下周检修复产预估表现来看, 因复产节点多集中于统计周期末端, 因此下周整体供应回升幅度或有扩张。这对于现在去库幅度收窄来说并不是一个好的征兆, 一旦供应增速超过去库幅度, 供需矛盾激化将再度压制市场情绪。此外, 目前虽有宏观预期推动市场价格逐步上移, 情绪好转, 但持续性的上涨动力有限, 投机情绪或伴随需求证伪和预期走弱而逐步趋于冷静。综合来看, 无论是宏观还是基本面均存在隐患, 因而需谨慎追高。下周迎来端午, 对实际交易日影响不大, 预计下周整体现货价格窄幅盘整, 或有向下调整可能。

宏观及化工市场情况

1、美国 5 月零售销售环比增长 0.3%, 预估为下降 0.2%, 前值为增长 0.4%。

2、美国上周首次申领失业救济人数为 26.2 万人, 预估为 24.5 万人, 前值为 26.1 万人。

3、美国 6 月纽约联储制造业指数为 6.6, 预期-15.1, 前值-31.8。

4、CME “美联储观察”: 美联储 7 月加息 25 个基点的概率为 67%, 据 CME

“美联储观察”: 美联储 7 月维持利率在 5.00%-5.25%不变的概率为 33%, 加

息 25 个基点至 5.25%-5.50%区间的概率为 67%；到 9 月维持利率不变的概率为 28.4%，累计加息 25 个基点的概率为 62.2%，累计加息 50 个基点的概率为 9.4%。

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。