

资讯速递

金石期货研究所，2023 年 10 月 12 日

晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：碳酸锂 2401 涨 6.97%、20 号胶 2312 涨 4.07%和红枣 2401 涨 3.82%；跌幅前三：液化气 2311 跌 2.85%、菜籽 2311 跌 2.56%和硅铁 2312 跌 1.36%。

农产品市场情况

1、新疆石河子 300 余万亩棉花机采拉开序幕，据中新网，9 月 30 日，新疆生产建设兵团棉花主产区、第八师石河子市 300 多万亩棉花机采拉开序幕。据介绍，目前该师 121 团、143 团、150 团等多个团场棉花采收全面展开。眼下，新疆石河子各团场棉田中的棉花已大面积吐絮。在 143 团通往各连队的道路上，不时有大型采棉机赶往棉田“执行任务”。

2、新棉加工：截止 10 月 12 日 2023/2024 年度新疆棉累计加工 16.97 万吨，较上一日增加 2.64 万吨，据全国棉花交易市场，截止 10 月 12 日 2023/2024 年度新疆棉累计加工 16.97 万吨，较上一日增加 2.64 万吨，较去年同期增加 2.86 万吨，同比增幅 20.3%。

金属市场情况

1、9 月份俄罗斯铜在 LME 注册仓库的占比降至 23%，据博易大师，伦敦金属交易所（LME）周二公布的数据显示，9 月份 LME 注册仓库中的俄罗斯铜库存占比为 23%，低于 8 月份的 25%。9 月份 LME 的俄罗斯铜库存为 38625 吨，高于 8 月份的 25675 吨；9 月份俄罗斯镍仓单为 9336 吨，占比 22.5%，8 月份俄罗斯镍仓单数量为 7068 吨；9 月份俄罗斯铝库存占比为 76%，低于 8 月份的 81%。这也是今年迄今的最大降幅。上月底 LME 在韩国光阳的注册仓库有大量仓单被注销。仓单注销通常用于交割。LME 的数据显示，9 月份 LME 的铝仓单为 132475 吨，低于 8 月份的 183650 吨。

2、阿塞拜疆 1-9 月黄金产量同比大幅下跌，阿塞拜疆国家统计委员会网站公布的数据显示，阿塞拜疆在 2023 年前 9 个月生产了 1732 公斤黄金，较去年同期下降了 23%。1-9 月白银产量同比下降 40%，至 3028 公斤，铜精矿产量同比增长 12%，至 0.211 万吨。

3、LME 有色金属现货升贴水，10 月 12 日 LME0-3 铜贴水 77.5 美元/吨，LME0-3 铝贴水 29 美元/吨，LME0-3 铅升水 23.05 美元/吨，LME0-3 锌贴水 28 美元/吨，LME0-3 锡贴水 310 美元/吨，LME0-3 镍贴水 284.99 美元/吨。

宏观及化工市场情况

1、乘联会：9 月新能源乘用车市场零售 74.6 万辆，同比上涨 22.1%，乘联会发布数据显示，9 月新能源乘用车市场零售 74.6 万辆，同比上涨 22.1%，环比上涨 4.2%。1-9 月新能源乘用车市场零售 518.8 万辆，同比上涨 33.8%。

2、乘联会：9 月新能源乘用车出口 9.1 万辆，同比增长 107%，乘联会数据显示，9 月新能源乘用车出口 9.1 万辆，同比增长 107%，环比 8 月增长 16%，占乘用车出口 25.4%；其中纯电动占比新能源出口的 94.7%，A0+A00 级纯电动出口占新能源出口的 48%。伴随着中国新能源的规模优势和市场扩张需求，中国制造新能源产品品牌越来越多地走出国门，在海外的认可度持续提升，以及服务网络的不断完善，由此新能源出口市场仍然向好，前景可期。9 月厂商出口方面，特斯拉中国 30,566 辆、比亚迪汽车 28,039 辆、上汽乘用车 12,678 辆、吉利汽车 5,026 辆、东风乘用车 4,028 辆、智马达汽车 2,146 辆、哪吒汽车 1,473 辆、创维汽车 1,420 辆、长城汽车 791 辆、小鹏汽车 766 辆、上汽通用五菱 597 辆、广汽传祺 536 辆、广汽埃安 527 辆。

3、中汽协：9 月汽车销售 285.8 万辆，同比增长 9.5%，中国汽车工业协会的数据显示，9 月当月，汽车产销延续增长态势，产销量均创历史同期新高。9 月份，汽车产销分别完成 285 万辆和 285.8 万辆，环比均增长 10.7%，同比分别增长 6.6% 和 9.5%。1-9 月份，汽车产销分别完成 2107.5 万辆和 2106.9 万辆，同比分别增长 7.3% 和 8.2%。

4、中汽协：9 月份我国汽车出口 44.4 万辆，同比增长 47.7%，据中国汽车工业协会的数据，9 月份，我国汽车出口 44.4 万辆，环比增长 9%，同比增长 47.7%。1 至 9 月份，汽车出口 338.8 万辆，同比增长 60%。新能源汽车的出口增幅明显高于传统燃油车的出口。9 月份，新能源汽车出口 9.6 万辆，同比增长 92.8%，1 至 9 月份，新能源汽车出口 82.5 万辆，同比增长 1.1 倍。

5、美国 9 月 PPI 同比上升 2.2%，美国 9 月 PPI 同比上升 2.2%，预期为 1.60%，前值为 1.60%。美国 9 月 PPI 环比上升 0.5%，预期为 0.30%，前值为 0.70%。

6、美国抵押贷款利率升至数十年新高，美国抵押贷款利率上周升至 2000 年以来的最高水平，继续抑制购房活动。MBA 公布的数据显示，截至 10 月 6 日当周，30 年期固定抵押贷款利率上升 14 个基点至 7.67%，为连续第五周上升。购房申请指数小幅上升，但仍接近近三十年来的最低水平，而包括再融资活动在内的整体抵押贷款申请指标也录得小幅上升。鉴于抵押贷款利率如此之高，许多在过去锁定了较低贷款利率的房主对搬家犹豫不决。这影响了住房供应，并导致房价保

持高位。在建筑商向潜在买家提供财务激励措施以购买新房之际，二手房销售持续低迷。

7、普京：俄罗斯和欧佩克+明年有可能将继续合作，俄罗斯总统普京在俄罗斯能源周论坛上发表讲话。普京表示，俄罗斯和欧佩克+组织明年有可能将继续合作。

8、EIA 短期能源展望报告将 2023 年全球原油需求增速预期下调 5 万桶/日至 176 万桶/日，将 2024 年全球原油需求增速预期下调 4 万桶/日至 132 万桶/日。

9、EIA 短期能源展望报告显示，预计 2023 年美国原油产量将增加 101 万桶/日，此前预期为增加 87 万桶/日，预计 2024 年美国原油产量将增加 20 万桶/日，此前为增加 38 万桶/日；预测 2023 年第四季度石油产量将达到创纪录的 1316 万桶/日。

10、美联储会议纪要：多数美联储官员认为再加息一次是适当的，美联储会议纪要显示，大多数美联储官员认为再加息一次是适当的，一些人希望辩论从“利率多高”转向“维持多长时间”。与会者表示通胀仍然高企，需要更多证据来验证价格压力正在减弱。

11、美联储会议纪要：与会者仍认为经济增长仍低于趋势水准 恢复经济平衡需要劳动力市场趋软，美联储会议纪要显示，与会者仍认为经济增长仍低于趋势水准，恢复经济平衡需要劳动力市场趋软；美联储工作人员对消费者和企业支出韧性的经济预估强于 7 月的预测；美联储工作人员预计 2023 年剩余时间的 GDP 增长将因 UAW 罢工而受到一定程度的抑制，其影响将在 2024 年消除；多位与会者指出，即使开始降息后，缩减资产负债表可能还会持续“一段时间”。

12、CME “美联储观察”：美联储 11 月维持利率不变的概率为 89.2%，据 CME “美联储观察”：美联储 11 月维持利率在 5.25%-5.50%区间不变的概率为 89.2%，加息 25 个基点至 5.50%-5.75%区间的概率为 10.8%。到 12 月维持利率不变的概率为 72.9%，累计加息 25 个基点概率为 25.2%，累计加息 50 个基点概率为 2.0%。

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。