

## 资讯速递

金石期货研究所，2023 年 10 月 16 日

### 晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：焦炭 2401 涨 4.54%、低硫燃油 2401 涨 4.44%和燃油 2401 涨 4.19；跌幅前三：烧碱 2405 跌 2.11%、碳酸锂 2401 跌 1.36%和花生 2311 跌 0.90%。

### 农产品市场情况

1、预计此次北疆明显降水降温及西部北部霜冻天气，对棉花采摘不利，据新疆兴农网，目前，南疆大部夏玉米成熟，巴州及阿克苏地区部分夏玉米仍处于灌浆期；全疆棉花处于吐絮盛期，北疆棉区及南疆部分棉区大面积采收棉花；全疆冬小麦陆续播种，其中塔城地区北部、天山北坡、巴州、阿克苏地区、喀什地区部分冬小麦已出苗。预计此次北疆明显降水降温及西部北部霜冻天气，对牲畜放牧采食及牧业转场、玉米晾晒及收储、棉花及林果采摘、冬小麦播种、设施农业生产不利。

2、未来四天气象条件对南疆大部秋收秋种有利，据新疆兴农网，目前，南疆绝大部夏玉米成熟；全疆棉花处于吐絮采收期；全疆大部冬小麦播种，播种早的陆续出苗。预计未来四天气象条件对南疆大部秋收秋种有利，10月15日气象条件对北疆、巴州北部和阿克苏地区部分农区秋收秋种不利。

3、USDA:截至10月5日当周2023/2024年度美国陆地棉出口净销售4.34万包，比前一周下降82%，据USDA最新数据，截止10月5日当周，2023/2024年度陆地棉的净销售为43400包，比前一周下降82%，比前4周平均水平下降63%。增加的主要是中国（21700包）、印度尼西亚（16700包）、墨西哥（5000包）、孟加拉国（4000包）和危地马拉（3000包），巴基斯坦（-8600包）、土耳其（-1100包）和韩国（-300包）。周度出口装船量为1104000包，创销售年度新低，较前一周下降31%，较前4周平均水平下降28%。目的地主要是中国（35600包）、巴基斯坦（17700包）、墨西哥（14900包）、越南（11100包）和孟加拉国（11100包）。2023/2024年度皮马棉的净销售为2500包，比前一周下降49%，比前4周平均水平下降56%。增加的主要是印度（1900包）、哥伦比亚（200包）、韩国（200包）、日本（100包）和中国（100包）。周度出口装船量为3400包，较前一周下降32%，较前4周平均水平下降17%。目的地为中国（2200

包)、越南(400包)、巴基斯坦(400包)、印度(300包)和泰国(100包)。

**4、新棉加工：**截止10月15日2023/2024年度新疆棉累计加工30.24万吨，较上一日增加3.77万吨，据全国棉花交易市场，截止10月15日2023/2024年度新疆棉累计加工30.24万吨，较上一日增加3.77万吨，较去年同期增加6.72万吨，同比增幅28.6%。

## 金属市场情况

**1、中国9月份煤炭进口同比增长27.5%，**据外媒报道，海关总署公布的数据显示，中国9月进口煤炭达到4214万吨，同比大幅攀升27.5%，进口商继续从国外进口较便宜的煤炭，为迎接冬季高峰需求做准备。8月创纪录的4430万吨进口量之后，9月进口量依然保持强劲。最近煤炭的强劲进口受国内煤价上涨的支撑。国内基准的秦皇岛离岸煤炭(FOB)煤价于10月9日最新报151.68美元/吨，高于6月19日的两年多低点116.42美元/吨。这在一定程度上是煤矿安全检查的结果，此前发生了一系列事故，导致供应暂时收紧。1-9月煤及褐煤进口量为34765.2万吨，较2022年同期进口的20084.3万吨增加73.1%。

**2、世界黄金协会：9月底全球黄金ETF总持仓仍处于2020年3月以来最低水平，**世界黄金协会数据显示，2023年9月，全球实物黄金ETF再次流出，截至月底流出约合30亿美元，相当于持仓减少59吨。9月，全球黄金ETF资产管理总规模(AUM)为1980亿美元，进一步受到金价下跌近4%的影响；总持仓减少2%，降至3282吨。9月，北美地区黄金ETF基金流出量居首，欧洲地区紧随其后，而亚洲则继续主导全球黄金ETF的流入。截至9月底，全球黄金ETF总持仓仍处于自2020年3月(3178吨)以来的最低水平，比2020年10月3916吨的历史高点低了16%。

**3、LME有色金属现货升贴水，**10月16日LME0-3铜贴水73.19美元/吨，LME0-3铝贴水27.55美元/吨，LME0-3铅升水22.75美元/吨，LME0-3锌贴水23.24美元/吨，LME0-3锡贴水334美元/吨，LME0-3镍贴水261.75美元/吨。

## 宏观及化工市场情况

**1、中国9月货币供应量M2同比增长10.3%，**预估为10.6%，前值为10.6%；中国9月社会融资规模增量4.12万亿元，预估为37000亿元，前值为31237亿元；中国9月新增人民币贷款2.31万亿元，预估为25000亿元，前值为13580亿元。

**2、美联储哈克表示，**美联储可能已经完成加息。预计通胀将稳步下降，今年将降至3%以下。

**3、CME“美联储观察”：**美联储11月维持利率不变的概率为89.4%，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89.4%，加息25个基点至5.50%-5.75%区间的概率为10.6%。到12月维持利率不变的概率为70.6%，累计加息25个基点概率为27.2%，累计加息50个基点概率为2.2%。

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。

42