

资讯速递

金石期货研究所，2023 年 10 月 17 日

晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：铁矿石 2401 涨 2.12%、焦煤 2401 涨 1.63%和焦炭 2401 涨 1.40%；跌幅前三：烧碱 2405 跌 3.89%、棉纱 2401 跌 2.29%和黄豆一号 2401 跌 2.21%。

农产品市场情况

1、8 月份澳大利亚对中国的棉花出口量激增至 61319 吨，据外媒近日报道，澳大利亚海关数据显示，8 月份澳大利亚对中国的棉花出口量激增至 61319 吨，价值 1.3 亿美元，是自 2014 年 7 月以来的最高水平。数据显示，澳大利亚从今年 6 月起对华棉花出口量逐步上升，其中 6 月份达 22638 吨，7 月为 45619 吨。

2、中国棉花购销周报：截至 2023 年 10 月 12 日，全国新棉交售率为 28.8%，同比下降 2.8 个百分点，据国家棉花市场监测系统对 14 省区 46 县市 900 户农户调查数据显示，截至 2023 年 10 月 12 日，全国新棉采摘进度为 29.4%，同比下降 5.0 个百分点，较过去四年均值下降 15.4 个百分点；全国交售率为 28.8%，同比下降 2.8 个百分点，较过去四年均值下降 36.3 个百分点。另据对 60 家大中型棉花加工企业的调查，截至 10 月 12 日，全国加工率为 36.2%，同比增长 5.5 个百分点，较过去四年均值增长 3.6 个百分点；新棉销售尚未开始。按照国内棉花预计产量 605 万吨（国家棉花市场监测系统 2023 年 9 月份预测）测算，截至 10 月 12 日，全国累计采摘籽棉折皮棉 177.6 万吨，同比减少 29.5 万吨，较过去四年均值减少 88.5 万吨；累计交售籽棉折皮棉 51.2 万吨，同比减少 14.2 万吨，较过去四年均值减少 130.8 万吨；累计加工皮棉 18.5 万吨，同比减少 1.6 万吨，较过去四年均值减少 39.8 万吨。

金属市场情况

1、需求暂无起色，动力煤港口库存创 8 周高位，据 Mysteel，节后刚需补库基本结束，上周煤价在跳涨后弱势回落，目前需求端暂无明显起色，市场表现平平，贸易商也多处观望态势。截至 10 月 13 日，55 个港口样本动力煤库存环比续增 2.34%至 6202.1 万吨，创 8 周高位，同比增幅达近 24%。其中，东北区域港口库存环比增幅达 12.38%，环渤海及江内港存增量明显，仅华南港存环比小降。而从同比数据来看，华南港存同比增幅最大，达 68.9%。

2、中国煤炭运销协会：上周重点煤炭企业销量环比增加，据证券时报网，中国煤炭运销协会 16 日发布煤炭市场运行周报，10 月 7 日-10 月 13 日当周，重点煤炭企业销量较上周增加，周度库存下降。港口方面，大秦线检修，进港资源量减少，使得节后港口市场运行偏强，价格走高。

3、力拓三季度铜产量超预期，力拓三季度铜产量 15.51 万吨，分析师预期 15.0354 万吨。铝土矿产量 1390 万吨，分析师预期 1419 万吨。氧化铝产量 190 万吨，分析师预期 192 万吨。铝产量 82.8 万吨，分析师预期 81.6665 万吨。100 铁矿石球团矿和精矿产量 240 万吨。该公司表示，长期来看，锂的市场基本面依然强劲。

4、智利总统：青山控股将投资超 2.3 亿美元建磷酸铁锂工厂，据外媒，正在北京访问的智利总统博里奇 16 日会见中国青山控股集团代表。博里奇宣布，青山控股将在智利投资超 2.33 亿美元，在安托法加斯塔地区建设最大年产能 12 万吨的磷酸铁锂工厂。该厂预计 2025 年 5 月投运，满负荷运转后将创造 668 个就业岗位。

5、力拓三季度皮尔巴拉铁矿石产量环比增加 3%，力拓发布三季度产销报告：1. 产量方面：三季度皮尔巴拉业务铁矿石产量为 8350 万吨，环比二季度增加 3%，同比减少 1%。2. 发运量方面：三季度皮尔巴拉业务铁矿石发运量为 8390 万吨，环比增加 6%，同比增加 1%。3. 此外，三季度加拿大铁矿石公司（IOC）的球团精粉总产量 240 万吨，环比增加 16%，同比减少 14%（力拓所属股权部分）。4. 2023 年力拓皮尔巴拉铁矿石发运目标（100%）为 3.2-3.35 亿吨，与 2022 年保持不变。

6、LME 有色金属现货升贴水，10 月 17 日 LME0-3 铜贴水 61 美元/吨，LME0-3 铝贴水 27.25 美元/吨，LME0-3 铅升水 39.5 美元/吨，LME0-3 锌贴水 22.5 美元/吨，LME0-3 锡贴水 330 美元/吨，LME0-3 镍贴水 272.5 美元/吨。

7、Newcrest 第三季度黄金产量因维修停工而下降，据外媒，澳大利亚最大的黄金开采商 Newcrest Mining 周二公布，由于本季度维修停工，第三季度黄金产量环比下降 18.1%。该矿商的 Cadia、Telfer 和 Brucejack 项目的计划维护活动导致本季度吞吐量下降，而 Red Chris 的产量因黄金品位下降而下降。Newcrest 在截至 9 月 30 日的三个月内生产了 454,312 盎司的贵金属。而截至 6 月 30 日的季度产量为 556187 盎司黄金。

宏观及化工市场情况

1、CME “美联储观察”：美联储 11 月维持利率不变的概率为 93.2%，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 93.2%，加息 25 个基点至 5.50%-5.75% 区间的概率为 6.8%。到 12 月维持利率不变的概率为 67.1%，累计加息 25 个基点概率为 31.0%，累计加息 50 个基点概率为 1.9%。

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。

✎