

资讯速递

金石期货研究所，2023 年 10 月 23 日

晚间收盘情况

商品期货中涨幅前三的品种为：液化气 2311 涨 2.13%、玉米淀粉 2401 涨 0.89% 和合成橡胶 2401 涨 0.82%；跌幅前三：红枣 2401 跌 3.73%、碳酸锂 2401 跌 3.55% 和苹果 2401 跌 3.17%。

农产品市场情况

1、中国 9 月自巴西进口大豆同比增长 23%，据外媒报道，周五公布的数据显示，中国 9 月自巴西进口大豆同比增长 23%，巴西丰产的大豆继续进入全球最大采购国手中。海关总署公布的数据显示，上个月中国从巴西进口 88 万吨大豆，为三年同期以来最高水平。巴西 3-6 月份期间出口大豆作物的数量最高，当时正值大豆收获期，随后出口逐步减少，但今年夏季月份的发货量要高于以往。9 月从第二大供应国美国进口的大豆数量缩减 133692 吨，远低于上年同期的 115 万吨。中国上个月总计进口大豆 715 万吨。今年迄今为止，中国进口了 5487 万吨巴西大豆，同比增加 18%。今年前 9 个月，美国大豆的进口总量为 2008 万吨，同比增长 8%。

2、中国 2023 年 1-9 月纱产量同比减 1.2%，布产量同比减 3.4%，国家统计局公布的最新数据显示，中国 1-9 月纱产量累计为 1674.1 万吨，同比减 1.2%。中国 1-9 月布产量累计为 229.6 亿米，同比减 3.4%。中国 1-9 月化学纤维产量累计为 5229.9 万吨，同比增 6.9%。

3、中国 2023 年 9 月纱产量同比减 0.9%，布产量同比减 3.5%，国家统计局公布的最新数据显示，中国 9 月纱产量为 193.6 万吨，同比减 0.9%。中国 9 月布产量为 27.3 亿米，同比减 3.5%。中国 9 月化学纤维产量为 631.4 万吨，同比增 12.1%。

4、ITMF：全球纺织业运行状况依然不佳，据中棉行协海外棉纺织市场观察 202337 期，根据国际纺联（ITMF）9 月中旬的调查报告，全球纺织业运行状况依然不佳，制造商对未来的发展形势持谨慎态度。从本次调查看，受访者对当前的经营状况持谨慎态度，经营状况指数仍为负 27 个百分点，整个纺织产业链面对成本上涨和需求不足都在苦苦挣扎。经营预期指数和上次调查相比也没有改善，仍在正 20 个百分点左右。2023 年 5 月，订单数量有短暂改善，但 7 月份又大幅下降，并在 9 月份触及新低（负 28 个百分点），整个产业链的订单数量都在最低水平。

只要品牌商和零售商的订单不增加，整个产业链将继续挣扎。9月份未交货订单数量略有增加，从上次1.9个月增加到2.2个月，但总体产能利用率仍很低，为69%，制造商预计这一趋势将持续下去。需求疲软是全球纺织业近一年来最主要的问题，9月份这一担忧加剧，原因是近几个月能源和原材料价格飙升引发高通胀。

5、全国秋粮已收获 77% 冬小麦冬油菜播种有序推进，农业农村部最新农情调度显示，全国秋粮已收获 77%，其中，大豆收获接近尾声，玉米收获近八成，中稻过八成。随着秋收进度不断加快，全国秋冬种也有序推进。农业农村部最新农情调度显示，目前，全国冬小麦播种完成意向面积的近四成，冬油菜播种完成意向面积的过五成。

6、轮台县万亩棉花待归仓，金秋时节采收忙，据央广网，金秋时节，新疆轮台县哈尔巴克乡 14.89 万亩棉花已经陆续成熟，进入采收期，棉农们正抢抓晴好天气开始采摘新棉。据了解，今年哈尔巴克乡种植的 14.89 万亩棉花中，机采棉 13.4 万亩，棉花种植总户数达 600 户，种植大户有 153 户。据了解，目前，手采棉采摘工作即将结束，预计 10 月 20 日开始机械采收，10 月下旬进入高峰期，11 月 5 日全面完成机械采收。

金属市场情况

1、海关总署：9 月中国锂矿进口量环比增加 93.2%，据海关总署，2023 年 9 月中国锂矿石进口数量为 49.9 万吨，环比增加 93.2%，同比增加 125.6%。其中从澳大利亚进口 39.9 万吨，环比增加 130.6%，同比增加 94.1%。自巴西进口 3.3 万吨，环比增加 327.5%，同比增加 504.2%。2023 年 1-9 月中国锂矿石进口数量为 316.2 万吨，同比增加 64.0%。其中从澳大利亚进口 263.0 万吨，同比增加 45.7%，从巴西进口 11.3 万吨，同比增加 53.9%。另外，从尼日利亚进口 17.2 万吨，同比增加 400.2%，从津巴布韦进口 16.9 万吨，同比增加 8128.5%。

2、瑞士 9 月黄金出口降至 15 个月低点，据博易大师，周四的瑞士海关数据显示，由于对印度和土耳其的出口减少，9 月份瑞士黄金出口为 99005 公斤，低于 8 月份的 123547 公斤，也低于去年同期的 175733 公斤，创下 15 个月以来的最低点。印度的需求通常会在年底的传统婚礼季和重大节日期间增加。但是由于国内金价上涨，上周印度现货黄金需求平平。

3、海关总署：9 月中国不锈钢出口环比减少 6.3%，据海关总署，2023 年 9 月，国内不锈钢进口量约 23.15 万吨，环比增加 32.5%；同比减少 15%。2023 年 1-9 月，该累计量约 138.58 万吨，同比减少 105.99 万吨，减幅 43.3%。2023 年 9 月，国内不锈钢出口量约 34.3 万吨，环比减少 6.3%；同比增加 22.1%。2023 年 1-9 月，该累计量约 310.81 万吨，同比减少 35.6 万吨，减幅 10.3%。2023 年 9 月，

国内不锈钢净出口量约 11.16 万吨，环比减少 41.8%，同比增加 1186.4%。2023 年 1-9 月累计净出口量约 172.23 万吨，同比增加 70.38 万吨，同比增加 69.1%。

4、IAI：9 月全球原铝产量为 587.1 万吨，同比增加 2.7%，国际铝业协会（IAI）报告显示，2023 年 9 月份全球原铝产量为 587.1 万吨，去年同期为 571.6 万吨，同比增加 2.7%，前一个月修正值为 605.1 万吨。9 月原铝日均产量为 19.57 万吨，前一个月为 19.52 万吨。预计 9 月中国原铝产量为 350.0 万吨，前一个月修正值为 360.7 万吨。

5、LME 有色金属现货升贴水，10 月 23 日 LME0-3 铜贴水 68.74 美元/吨，LME0-3 铝贴水 24.49 美元/吨，LME0-3 铅升水 41.25 美元/吨，LME0-3 锌贴水 4.55 美元/吨，LME0-3 锡贴水 207 美元/吨，LME0-3 镍贴水 182 美元/吨。

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 96.1%，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 96.1%，降息 25 个基点至 5.00%-5.25%区间的概率为 3.9%。到 12 月维持利率不变的概率为 73.0%，累计加息 25 个基点的概率为 24.1%，累计降息 25 个基点的概率为 2.9%。

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。