

撰写人: 陈一兰 从业资格证号: F3010136

投资咨询从业证书号: Z0012698

| 项目类别 | 数据指标   | 最新       | 环比       | 数据指标                   | 最新       | 环比        |
|------|--|----------|----------|------------------------|----------|-----------|
| 期货市场 | JM2205合约收盘价(日,元/吨)   | 2350.50  | +55.50↑  | J2205合约收盘价(日,元/吨)      | 3181.00  | +10.00↑   |
|      | JM2205合约持仓量(日,手)   | 41741.00 | +482.00↑ | J2205合约持仓量(日,手)        | 33401.00 | +70.00↑   |
|      | 焦煤前20名合约净持仓(日,手)   | 1272.00  | +104.00↑ | 焦炭前20名净持仓(日,手)         | 1827.00  | +710.00↑  |
|      | JM2205-9合约价差(日,元/吨)  | 132.00   | -10.00↓  | J2205-9合约价差(日,元/吨)     | 163.00   | +7.00↑    |
| 现货市场 | 焦煤仓单(日,张)  | 400.00   | 0.00     | 焦炭仓单(日,张)              | 640.00   | -4920.00↓ |
|      | 山西柳林主焦煤(日,元/吨)<br>(A9.5,V21-23,S0.7,G>85)  | 2680.00  | +230.00↑ | 唐山准一级冶金焦(日,元/吨)        | 3120.00  | 0.00      |
|      | 河北沙河驿主焦煤(日,元/吨)<br>(A10,V25,G70,S0.4)  | 2535.00  | 0.00     | 唐山二级冶金焦(日,元/吨)         | 3060.00  | 0.00      |
|      | 山西晋中灵石低硫主焦(日,元/吨)<br>(A10.5,S0.7,V20,G80,Y12,GSR60,Mt8,岩相0.1)  | 2600.00  | +500.00↑ | 天津港一级冶金焦(日,元/吨)        | 3310.00  | +200.00↑  |
|      | 京唐港澳澳大利亚进口主焦煤(日,元/吨)<br>(A:9.3%,V24%,S<0.5%,CSR:71%)   | 2500.00  | 0.00     | 天津港准一级冶金焦(日,元/吨)       | 3210.00  | +200.00↑  |
|      | JM2205合约基差(日,元/吨)  | 184.50   | -55.50↓  | J2205合约基差(日,元/吨)       | -61.00   | -10.00↓   |
|      | 洗煤厂原煤库存(周,万吨)  | 261.42   | -0.01↓   | 洗煤厂精煤库存(周,万吨)          | 176.86   | -8.41↓    |
| 上游情况 | 洗煤厂开工率(周,%)  | 75.79    | +6.02↑   | 原煤产量(月,万吨)             | 35708.90 | +2299.10↑ |
|      | 煤及褐煤进口量(月,万吨)  | 3505.20  | +811.20↑ | 焦炭港口库存(周,万吨)           | 204.80   | +17.50↑   |
|      | 进口炼焦煤港口库存(周,万吨)  | 444.00   | +33.00↑  | 全国100家独立焦化厂焦炭库存(周,万吨)  | 43.61    | +5.60↑    |
| 产业情况 | 全国100家独立焦化厂炼焦煤库存(周,万吨)   | 662.28   | +24.62↑  | 全国110家样本钢厂焦炭库存(周,万吨)   | 444.57   | +6.58↑    |
|      | 全国110家钢厂炼焦煤库存(周,万吨)  | 802.79   | +13.04↑  | 钢厂焦炭可用天数(周,天数)         | 16.51    | -0.63↓    |
|      | 焦化厂炼焦煤可用天数(周,天数)   | 16.86    | +0.58↑   | 焦炭及半焦炭出口量(月,万吨)        | 43.00    | +3.00↑    |
|      | 炼焦煤进口量(月,万吨)   | 438.40   | +3.75↑   | 焦企剔除淘汰产能利用率(周,%)       | 72.19    | +2.18↑    |
|      | 炼焦煤产量(月,万吨)  | 4237.00  | +179.00↑ | 独立焦化厂吨焦盈利情况(周,元/吨)     | 203.00   | +145.00↑  |
| 下游情况 | 独立焦化厂吨焦盈利情况(周,元/吨)   |          |          | 焦炭产量(月,万吨)             | 3385.10  | -214.00↓  |
|      | 全国247家钢厂高炉开工率(周,%)   | 74.20    | +3.19↑   | 全国247家钢厂高炉炼铁产能利用率(周,%) | 77.89    | +2.10↑    |
|      | 粗钢日均产量(旬,万吨/天)   | 209.22   | +20.17↑  | 粗钢产量(月,万吨)             | 6931.30  | -227.06↓  |
| 行业消息 | 1.长治沁源地区在水果外包装检测出阳性,受此影响,沁源县王陶乡一带煤矿开始实行封闭式管理,暂停对内及对外运输,等待全员核算检测结果。截止目前沁源县内王陶乡地区煤矿及洗煤厂有停产现象,涉及煤矿炼焦原煤产能850万吨,若按满产测算,预计影响原煤日产2.4万吨左右,所产煤种均为优质主焦及瘦主焦煤,其他地区暂未有停产消息。   |          |          |                        |          |           |
| 观点总结 | <p>焦煤:煤矿陆续开工复产,洗煤厂综合开工率及日均产量有所增长,不过部分产区仍受疫情影响,短期供应存一定扰动。下游吨焦盈利回暖、钢厂复产增多对焦煤持有一定采购积极性,下游补库意愿较强为期价带来较强向上驱动。技术上,JM2205合约大幅上涨,小时MACD指标显示红柱扩张,关注下方均线支撑。操作上,日内短线操作,注意风险控制。</p> <p>焦炭:目前部分焦企仍受环保限产,整体仍处低产状态,短期供应难以回升。焦价三轮提涨落地,吨焦盈利出现大幅回升。近阶段下游钢厂复产逐步兑现,实际产量也有所回升,对焦炭补库需求向好。不过临近假期且疫情影响,市场预期下游补库或逐步趋缓,期价上冲或较为乏力。短期行情或有反复,注意风险控制。技术上,J2205合约探低回升,小时MACD指标显示绿柱缩窄,下方关注均线支撑。操作上,3140附近轻仓做多,止损40点。</p> |          |          |                        |          |           |
| 重点关注 | 周度供需数据及下游钢厂复产情况  |          |          |                        |          |           |

数据来源第三方,观点仅供参考。市场有风险,投资需谨慎!

备注: JM:焦煤 J: 焦炭



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!