

撰写人：许方莉 从业资格证号：F3073708 投资咨询从业证书号：Z0017638

| 项目类别 | 数据指标  | 最新       | 环比        | 数据指标                     | 最新       | 环比        |
|------|---|----------|-----------|--------------------------|----------|-----------|
| 期货市场 | JM主力合约收盘价（日，元/吨）  | 1855.00  | -27.50↓   | J主力合约收盘价（日，元/吨）          | 2815.50  | +4.00↑    |
|      | JM主力合约持仓量（日，手）  | 75678.00 | +1312.00↑ | J主力合约持仓量（日，手）            | 33226.00 | -511.00↓  |
|      | 焦煤前20名合约净持仓（日，手）  | -7287.00 | -1237.00↓ | 焦炭前20名合约净持仓（日，手）         | 461.00   | -117.00↓  |
|      | JM9-5月合约价差（日，元/吨）   | -88.50   | +61.50↑   | J9-5月合约价差（日，元/吨）         | -209.00  | +42.50↑   |
|      | 焦煤仓单（日，张）   | 0.00     | 0.00      | 焦炭仓单（日，张）                | 1000.00  | 0.00      |
| 现货市场 | 山西吕梁柳林低硫主焦煤（日，元/吨）<br>(A9.5,S0.8,V24, G>85, GSR65, Mt10, 岩相0.15)  | 2560.00  | 0.00      | 唐山一级冶金焦（日，元/吨）           | 2915.00  | 0.00      |
|      | 京唐港澳大利亚进口主焦煤（日，元/吨）<br>(A9.3%,V24%,S<0.5%,CSR:71%)  | 2350.00  | 0.00      | 唐山二级冶金焦（日，元/吨）           | 2550.00  | 0.00      |
|      | 山西晋中灵石低硫主焦（日，元/吨）<br>(A10, S1.3, V25, G80, Y12, GSR60, Mt8, 岩相 0.1)   | 2350.00  | 0.00      | 天津港一级冶金焦（日，元/吨）          | 2910.00  | 0.00      |
|      | JM主力合约基差（日，元/吨）   | 495.00   | +27.50↑   | 天津港准一级冶金焦（日，元/吨）         | 2810.00  | 0.00      |
|      |   |          |           | J主力合约基差（日，元/吨）           | 99.50    | -4.00↓    |
| 上游情况 | 洗煤厂原煤库存（周，万吨）   | 259.13   | -15.17↓   | 洗煤厂精煤库存（周，万吨）            | 163.33   | -21.25↓   |
|      | 洗煤厂开工率（周，%）   | 75.23    | -0.36↓    | 原煤产量（月，万吨）               | 39130.60 | +2121.10↑ |
|      | 煤及褐煤进口量（月，万吨）   | 3231.00  | +313.00↑  |                          |          |           |
| 产业情况 | 进口炼焦煤港口库存（周，万吨）   | 106.90   | -7.60↓    | 焦炭港口库存（周，万吨）             | 195.50   | -20.10↓   |
|      | 全国230家独立焦化厂炼焦煤库存（周，万吨）  | 1025.70  | +12.80↑   | 全国230家独立焦化厂焦炭库存（周，万吨）    | 47.20    | -1.00↓    |
|      | 全国 247 家钢厂炼焦煤库存（周，万吨）   | 886.17   | +22.47↑   | 全国 247家样本钢厂焦炭库存（周，万吨）    | 633.39   | +27.28↑   |
|      | 全国230家独立焦化厂炼焦煤可用天数（周，天数）  | 13.70    | 0.00      | 全国 247家样本钢厂焦炭可用天数（周，天数）  | 13.07    | +0.66↑    |
|      | 炼焦煤进口量（月，万吨）  | 684.50   | +111.28↑  | 焦炭及半焦炭出口量（月，万吨）          | 62.00    | +12.00↑   |
|      | 炼焦煤产量（月，万吨）   | 4125.00  | +104.00↑  | 焦企剔除淘汰产能利用率（周，%）         | 72.80    | +1.10↑    |
|      |   |          |           | 独立焦化厂吨焦盈利情况（周，元/吨）       | -14.00   | -57.00↓   |
| 下游情况 |   |          |           | 焦炭产量（月，万吨）               | 3738.70  | -144.70↓  |
|      | 全国 247 家钢厂高炉开工率（周，%）  | 74.64    | -0.57↓    | 全国 247 家钢厂高炉炼铁产能利用率(周,%) | 81.93    | -0.66↓    |
|      | 粗钢产量（月，万吨）  | 7454.40  | -521.50↓  |                          |          |           |
| 行业消息 | 1.央视消息，据统计，2022年榆林市原煤产量为5.82亿吨，在上一年高基数的基础上实现了5.4%的同比增速，月均产量保持在4850万吨以上。   |          |           |                          |          |           |
|      | 2.山西综改示范区1月8日消息，日前，在“一带一路”沿线国家印度尼西亚，由赛鼎工程有限公司总承包的德信钢铁有限公司150万吨/年焦化工程首座焦炉顺利烘炉。据了解，这是赛鼎工程有限公司的首个海外EPC项目，也是在东南亚首座超大型顶装7.1m焦炉。印尼德信钢铁公司是 国家“一带一路”重点建设项目，也是大型钢铁联合企业德龙集团顺应国家产业转移政策，推动钢铁产业“走出去”战略，布局开发海外市场的又一重要举措。  |          |           |                          |          |           |
| 观点总结 | 焦煤：焦煤市场稳中偏弱运行。临近春节，部分煤矿已经开始放假，大矿于下周开始停产放假，加上疫情对生产仍有一定影响，洗煤厂开工率小幅下降，焦煤供应持续收紧。焦炭二轮提降落地，焦企亏损扩大，多执行前期订单，短期虽仍存一定补库需求，在焦煤供需偏紧和下游放缓采购的共同作用下，煤价窄幅调整，炼焦煤线上竞拍流拍率降低。此外，高炉检修停减产增多，预计焦企开工将会下滑，节前煤炭回归供需双弱格局。进口方面，蒙古国进口炼焦煤市场偏强运行。后续需关注钢厂放假安排。技术上，JM2305合约探底回升，一小时K线先下穿多日均线后重新站上5日均线。操作上，建议以偏弱震荡思路对待。 |          |           |                          |          |           |
|      | 焦炭：焦炭市场弱势运行。煤矿陆续放假，焦煤供应持续下滑，线上竞拍成交冷清，部分煤种价格下调。现货方面，焦炭二轮提降落地，高炉停减产情况增多，不少工程处于收尾阶段，钢材需求持续走弱，钢厂补库陆续接近尾声，以按需采购为主，焦企出现小幅累库。港口方面，焦炭成交略有好转，港口库存小幅回升。技术上，J2305合约探底回升，一小时KDJ指标显示三线纠缠。操作上，以震荡思路对待，关注上方2840附近压力。   |          |           |                          |          |           |
| 重点关注 | 1月13日 Mysteel 焦钢厂开工率及双焦库存   |          |           |                          |          |           |

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！