


撰写人：蔡跃辉
从业资格证号：F0251444
投资咨询从业证书号：Z0013101

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	CZCE ZC主力合约收盘价(日,元/吨)	-	-	CZCE ZC1-9价差(日,元/吨)	-	-
	CZCE ZC持仓量(日,手)	0.00	0	ZC前20名净持仓(上日,手)	0	0
	ZC前20名多头(上日,手)	0	0	ZC前20名空头(上日,手)	0	0
现货市场	秦皇岛港Q5500,S0.6,MT8山西(日,元/吨)	845.00	0.00	山西晋城Q5500,A20,V9,S1.5,MT8	700.00	0.00
	广州港 Q5500,S0.4,MT17 内蒙古(日,元/吨)	925.00	0.00	车板含税价(日,元/吨)		
	CZCE ZC主力合约基差 (秦皇岛港)(日,元/吨)	-	-	印尼Q<5000, S<0.8, A<6, V<45, MT<20, FOB不含税 (日,美元/吨)	80	0.00
产业情况	55港库存 (周,万吨)	7,179.10	-43.30↓	京唐港库存 (周,万吨)	694.9	-32.10↓
	秦皇岛港库存 (周,万吨)	567.00	-1.00↓	广州港库存 (周,万吨)	317.4	+16.00↑
	曹妃甸港库存 (周,万吨)	523.00	+4.00↑	环渤海动力煤价格指数(周,元/吨)	715.00	-4.00↓
	原煤产量(月,万吨)	38,545.60	+400.60↑	动力煤进口量(月,万吨)	1,396.01	+296.76↑
下游情况	全国72家电厂样本区域存煤 (周,万吨)	1,265.60	+47.00↑	全国72家电厂样本区域存煤可用天数 (周,天)	26.00	0.00
	全国72家电厂样本区域日耗 (周,万吨)	48.30	+1.41↑	全国发电量(月,亿千瓦时)	6,885.80	+302.30↑
	全国用电量(月,亿千瓦时)	7,221.95	+321.40↑	全国水力发电(月,亿千瓦时)	820.20	+136.60↑
	全国火力发电(月,亿千瓦时)	5,985.00	+1272.00↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	146.31	0.00	标的历史40日波动率(日,%)	104.07	0.00
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	0.00	0.00	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	0.00	0.00
行业消息	1.近期,国家能源集团召开“绿色国能走廊”、在京“绿色办公楼宇”绿证试点交易启动会。意味着该集团全产业100%绿电消费工作进入实质性实施阶段。据了解,为贯彻落实国家绿电消费相关要求,发挥绿电消费先行带头作用,国家能源集团决定2023年开展全产业100%绿电消费工作,并且列为今年的重点任务。					
	2.7月4日晚间,华能水电披露了上半年发电量完成情况。根据公司统计,截至今年6月30日,公司2023年上半年完成发电量370.95亿千瓦时,同比减少25.44%,上网电量368.09亿千瓦时,同比减少25.48%。				更多资讯请关注!	
观点总结	动力煤市场暂稳运行。供应方面,产地以保供长协为主,市场成交氛围一般,发运成本有一定倒挂,随着近期需求释放,现货市场有挺价情绪。需求方面,电厂日耗日渐攀升,下游库存加速消化,港口库存去库效率明显提升,不过终端采购热情依然偏低,煤炭供应增速大于需求,煤价偏震荡运行。进口方面,汇率震荡,贸易商可操作空间收窄,国内电厂采购情绪不高,不过随着国内需求回暖,进口煤价止跌企稳。策略建议:观望。					
重点关注	更多观点请咨询!					