

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	JM主力合约收盘价 (日, 元/吨)	2117.50	-25.50↓	J主力合约收盘价 (日, 元/吨)	2751.00	-17.50↓
	JM主力合约持仓量 (日, 手)	64671.00	+39.00↑	J主力合约持仓量 (日, 手)	39924.00	-634.00↓
	焦煤前20名合约净持仓 (日, 手)	236.00	-544.00↓	焦炭前20名合约净持仓 (日, 手)	1531.00	+334.00↑
	JM5-1月合约价差 (日, 元/吨)	-375.50	-7.00↓	J5-1月合约价差 (日, 元/吨)	-232.00	-9.50↓
	焦煤仓单 (日, 张)	0.00	0.00	焦炭仓单 (日, 张)	550.00	0.00
现货市场	山西吕梁柳林低硫主焦煤 (日, 元/吨)	2480.00	0.00	唐山一级冶金焦 (日, 元/吨)	2900.00	0.00
	(A9.5,S0.8,V24, G>85, GSR65, Mt10, 岩相0.15)			唐山二级冶金焦 (日, 元/吨)	2650.00	0.00
	京唐港澳大利亚进口主焦煤 (日, 元/吨)	2350.00	0.00	天津港一级冶金焦 (日, 元/吨)	2810.00	0.00
	(A9.3%,V24%,S<0.5%,CSR:71%)			天津港准一级冶金焦 (日, 元/吨)	2710.00	0.00
	山西晋中灵石低硫主焦 (日, 元/吨)	2100.00	0.00	J主力合约基差 (日, 元/吨)	149.00	+17.50↑
上游情况	(A10, S1.3, V25, G80, Y12, GSR60, Mt8, 岩相 0.1)					
	JM主力合约基差 (日, 元/吨)	-17.50	+25.50↑			
	洗煤厂原煤库存 (周, 万吨)	222.41	+12.50↑	洗煤厂精煤库存 (周, 万吨)	148.98	-0.78↓
	洗煤厂开工率 (周, %)	73.89	-2.12↓	原煤产量 (月, 万吨)	37044.00	-222.30↓
	煤及褐煤进口量 (月, 万吨)	2946.00	+594.00↑			
产业情况	进口炼焦煤港口库存 (周, 万吨)	192.10	-12.20↓	焦炭港口库存 (周, 万吨)	258.80	-4.00↓
	全国230家独立焦化厂炼焦煤库存 (周, 万吨)	957.30	+27.50↑	全国230家独立焦化厂焦炭库存 (周, 万吨)	71.20	-4.30↓
	全国 247 家钢厂炼焦煤库存 (周, 万吨)	824.16	+0.90↑	全国 247家样本钢厂焦炭库存 (周, 万吨)	645.30	-2.73↓
	全国230家独立焦化厂炼焦煤可用天数 (周, 天数)	12.50	+0.60↑	全国 247家样本钢厂焦炭可用天数 (周, 天数)	11.66	-0.15↓
	炼焦煤进口量 (月, 万吨)	640.60	+28.80↑	焦炭及半焦炭出口量 (月, 万吨)	101.00	+10.00↑
下游情况	炼焦煤产量 (月, 万吨)	4063.00	-14.00↓	焦企剔除淘汰产能利用率 (周, %)	74.70	+0.80↑
				独立焦化厂吨焦盈利情况 (周, 元/吨)	-45.00	+67.00↑
				焦炭产量 (月, 万吨)	3910.60	+30.90↑
	全国 247 家钢厂高炉开工率 (周, %)	83.50	+0.69↑	全国 247 家钢厂高炉炼铁产能利用率(周,%)	88.98	-0.16↓
	粗钢产量 (月, 万吨)	8386.80	+243.94↑			
行业消息	1.10月12日晚甘其毛都口岸通知禁止外调车辆进入口岸, 国内方向汽运暂停, 铁路还可少量运输, 蒙煤通关进口暂不受影响。据Mysteel与口岸部分主要进口商沟通交流获悉, 本次外运暂停主要受周边临河、五原等地疫情蔓延影响, 口岸内部并未发现疫情。					
	2.2022年10月12日, 山西新景矿煤业有限责任公司发生一起死亡1人的安全事故。山西省应急管理厅、山西省地方煤矿安全监督管理局责令山西新景矿煤业有限责任公司, 从即日起停止生产按规定进行整顿。并撤销山西新景矿煤业有限责任公司一级标准化等级。					
观点总结	焦煤: 焦煤市场稳中偏强运行。近期煤矿事故频发, 多地由于再度爆发疫情进行静默管理, 山西部分地区已经下放煤矿停产通知, 加上二十大会议在即, 炼焦煤供应紧张。炼焦煤线上竞拍热情不减, 多有溢价, 上抬煤价, 加上煤炭运费上涨, 煤价仍在上行。下游方面, 焦炭利润不佳, 但成本压力不减, 短期仍有一定补库需求, 目前保持按需采购。总体来看, 会议前焦煤保持旺季偏强态势, 但后续上涨驱动不足, 重大会议后由于需求驱动不足或将回落。技术上, JM2301合约冲高回落, 一小时BOLL指标显示开口走平, K线运行至中轨以下, KDJ指标显示J线向下与K线和D线相交。操作上, 关注下方2100支撑, 短线尝试逢低做多, 注意风险控制。					
	焦炭: 焦炭市场稳中偏强运行。原料端, 山西部分矿区已有停产通知, 加上煤矿仍有停减产预期, 运费上行, 焦煤线上竞拍活跃度, 供需偏紧的格局下焦炭价格偏强, 焦企入炉成本高。多地疫情影响煤炭运输中转, 焦企提产意愿低, 二十大临近, 焦钢厂均有限产预期, 焦企已有不同程度减产, 吕梁、汾阳地区静默时间延长, 焦企限产力度普遍至40%-50%, 目前焦企开启二轮提涨, 钢厂暂无回应。下游方面, 钢材去库幅度有限, 终端拿货谨慎, 建筑钢材成交低位, 需求回暖速度较慢, 利润空间小。技术上, J2301合约冲高回落, 一小时MACD指标显示绿色动能柱持续扩散。操作上, 建议短线以震荡思路对待, 可布局远期空单, 注意风险控制。					
重点关注	10月14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