

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)	1956.00	+31.50↑	JM主力合约收盘价(日, 元/吨)	2649.50	+21.50↑	
	JM主力合约持仓量(日, 手)	48815.00	-2930.00↓	JM主力合约持仓量(日, 手)	32272.00	-807.00↓	
	焦煤前20名合约净持仓(日, 手)	1868.00	-1633.00↓	焦炭前20名合约净持仓(日, 手)	-1327.00	-224.00↓	
	JM1-9月合约价差(日, 元/吨)	-180.00	-3.50↓	J1-9月合约价差(日, 元/吨)	-144.50	+17.00↑	
	焦煤仓单(日, 张)	0.00	0.00	焦炭仓单(日, 张)	770.00	0.00	
现货市场	山西吕梁柳林低硫主焦煤(日, 元/吨) (A9.5,S0.8,V24, G>85, GSR65, Mt10, 岩相0.15)	2550.00	0.00	唐山一级冶金焦(日, 元/吨)	2680.00	0.00	
	京唐港澳澳大利亚进口主焦煤(日, 元/吨) (A9.3%,V24%,S<0.5%,CSR:71%)	2550.00	0.00	唐山二级冶金焦(日, 元/吨)	2450.00	0.00	
	山西晋中灵石低硫主焦(日, 元/吨) (A10, S1.3, V25, G80, Y12, GSR60, Mt8, 岩相 0.1)	2400.00	0.00	天津港一级冶金焦(日, 元/吨)	2710.00	0.00	
	JM主力合约基差(日, 元/吨)	444.00	-31.50↓	天津港准一级冶金焦(日, 元/吨)	2610.00	0.00	
	洗煤厂原煤库存(周, 万吨)	214.39	-0.78↓	JM主力合约基差(日, 元/吨)	30.50	-21.50↓	
上游情况	洗煤厂开工率(周, %)	71.13	-0.44↓	洗煤厂精煤库存(周, 万吨)	217.93	+5.68↑	
	煤及褐煤进口量(月, 万吨)	1898.00	-157.00↓	原煤产量(月, 万吨)	37931.30	+1148.00↑	
	进口炼焦煤港口库存(周, 万吨)	223.40	+11.20↑	焦炭港口库存(周, 万吨)	262.10	-2.90↓	
	全国230家独立焦化厂炼焦煤库存(周, 万吨)	778.80	-74.90↓	全国230家独立焦化厂焦炭库存(周, 万吨)	74.40	+15.50↑	
	全国247家钢厂炼焦煤库存(周, 万吨)	832.68	-13.62↓	全国247家样本钢厂焦炭库存(周, 万吨)	594.27	-18.59↓	
产业情况	全国230家独立焦化厂炼焦煤可用天数(周, 天数)	12.00	-0.10↓	全国247家样本钢厂焦炭可用天数(周, 天数)	12.27	+0.20↑	
	炼焦煤进口量(月, 万吨)	498.31	+41.79↑	焦炭及半焦炭出口量(月, 万吨)	93.00	-2.00↓	
	炼焦煤产量(月, 万吨)	4131.00	+45.00↑	焦企剔除淘汰产能利用率(周, %)	66.10	-5.90↓	
				独立焦化厂吨焦盈利情况(周, 元/吨)	-304.00	-155.00↓	
				焦炭产量(月, 万吨)	4145.80	-30.20↓	
下游情况	全国247家钢厂高炉开工率(周, %)	73.16	-3.82↓	全国247家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %)	81.40	-2.61↓	
	粗钢产量(月, 万吨)	9072.97	-588.33↓				
行业消息	1.据中钢协数据显示，2022年7月中旬，重点钢企粗钢日均产量203.79万吨，环比下降1.78%；钢材库存量1903.13万吨，比上旬增加98.34万吨，增长5.45%。 2.近日，山西省政府办公厅出台《关于推动焦化行业高质量发展的意见》。《意见》提出，2023年底前，全省焦化企业要全面实现干法熄焦，完成超低排放改造，全面关停4.3米焦炉以及不达超低排放标准的其他焦炉。新建焦化升级改造项目和各设区市城市建成区及周边20公里范围内的现有焦化企业，按规定时限实施环保深度治理。到2025年，全行业能耗总量和能耗强度较2020年实现“双下降”，焦化企业全面迈过“生存线”，力争30%以上企业达到“发展线”。						
观点总结	焦煤：焦煤市场偏弱运行。焦炭四轮提降落地后，焦企亏损加剧，限产力度加大，对炼焦煤采购需求进一步压缩。内蒙古地区大部分民营煤矿已停止生产，国有大矿原煤竞拍价格下跌。整体市场信心不足，成交冷清，炼焦煤竞拍市场流拍率高。由于行业困境和经营亏损，下游钢铁减量突出，短期需求不振前提下，供需改善可能会更依托于供应端收缩。短期焦煤仍有下跌空间。技术上，JM2209合约冲高回落，一小时KDJ指标显示J线向下与K线和D线交于80轴附近，期价有下跌趋势。操作建议：可尝试在1965附近短线做空，止损参考：1985元/吨。						
	焦炭：焦炭市场偏弱运行。炼焦煤竞拍市场流拍率高，国有大矿原煤竞拍价格下跌。焦炭四轮提降落地，上周累跌440元/吨，焦钢企亏损严重，放缓采购，限产力度均有加大。7月钢材价格下滑严重，需求不足，采购不积极。在高温多雨和疫情反复的影响下，目前需求端难以改善，钢厂营收情况惨淡，据Mysteel调研数据来看，超过9成的钢厂处于亏损状态，环比上月亏损面进一步扩大，供应端或将进一步收缩。技术上，J2209合约冲高回落，一小时KDJ指标显示J线向下与K线和D线交于80轴附近，期价有下跌趋势。操作建议：可尝试在2653附近短线做空，止损参考2675。						更多观点请咨询！
重点关注							

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

