

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	CZCE ZC主力合约收盘价(日,元/吨)	866.60	+21.20↑	CZCE ZC1-9价差(日,元/吨)	-	-
	CZCE ZC持仓量(日,手)	190.00	-2↓	ZC前20名净持仓(上日,手)	-23	+2↑
	ZC前20名多头(上日,手)	171	-22↓	ZC前20名空头(上日,手)	194	-24↓
现货市场	秦皇岛港Q5500,S0.6,MT8山西(日,元/吨)	900.00	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)	1,000.00	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)	33.40	-21.20↓	印尼Q<5000, S<0.8, A<6, V<45, MT<20, FOB不含税 (日,美元/吨)	154	0.00
产业情况	55港库存 (周,万吨)	5,832.20	+148.80↑	黄骅港库存 (周,万吨)	183	+23.00↑
	秦皇岛港库存 (周,万吨)	580.00	+42.00↑	广州港库存 (周,万吨)	327.1	+4.30↑
	曹妃甸港库存 (周,万吨)	527.00	+15.00↑	环渤海动力煤价格指数(周,元/吨)	733.00	0.00
	原煤产量(月,万吨)	36,783.30	+503.70↑	动力煤进口量(月,万吨)	317.45	-7.54↓
下游情况	全国72家电厂样本区域存煤 (周,万吨)	1,180.20	+1.00↑	全国72家电厂样本区域存煤可用天数 (周,天)	22.00	-1.80↓
	全国72家电厂样本区域日耗 (周,万吨)	53.69	+4.24↑	全国发电量(月,亿千瓦时)	6,410.20	+324.50↑
	全国用电量(月,亿千瓦时)	6,715.62	+353.66↑	全国水力发电(月,亿千瓦时)	1,217.00	+299.10↑
	全国火力发电(月,亿千瓦时)	4,045.00	+37.00↑			
期权市场	标的的历史20日波动率(日,%)	29.63	+1.32↑	标的的历史40日波动率(日,%)	27.93	+0.48↑
	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.据中国煤炭工业协会统计与信息部统计,全国大型煤炭企业主要生产技术指标明显提升。1-5月,协会直报大型煤炭企业回采工作面平均个数1335个,同比增加20个;回采工作面累计平均月产量为85243吨,同比增加5913吨,增长7.45%。 2.中电联规划发展部副主任叶春接受采访时透露,2021年8月以来,大型发电集团煤电板块整体亏损,甚至部分集团的煤电板块亏损面达到100%。据大致测算,2021年因电煤价格上涨导致全国煤电企业电煤采购成本额外增加6000亿元左右。进入2022年,1-5月份,由于电煤价格大幅上涨,导致全国煤电企业电煤采购成本同比额外增加1900亿元左右。					
观点总结	动力煤市场暂稳运行。月初煤管票充足,保供政策持续推进,矿区积极增产,中长协用煤供给充足,市场可售煤相对紧张。站台及贸易商拉运积极,市场可销售资源偏紧。气温持续升高,高温天气对当前沿海电厂耗煤水平起明显拉升作用,电厂日耗持续提升,非电企业及居民端制冷需求提升。但由于近期南方遭遇台风侵袭,华南地区降雨持续,水力发电抑制部分耗煤需求。港口市场积极性提升,但库存压力仍存,疏港进程缓慢。进口方面国际需求强劲,国内限价持续推进,印尼矿方报价暂稳,低卡煤偏弱运行,进口需求低迷。操作建议:观望。					
重点关注	7月8日Mysteel 电厂日耗、库存及可用天数					

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: ZC: 动力煤



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!