

CIOPI WEEKLY

中国铁矿石价格指数周报

2016.6.20~2016.6.24

中国铁矿石价格指数办公室

CIOP I

中国铁矿石价格指数

本周重点数据一览

数据	本周末	上周末
62%直进	51.54	51.21
CSP I 综合	67.83	68.80
矿石港存	10268	10057
矿石企存	4137.2	3988.97
BDI	609	587
I1609	385	372.5
钢材社存	896.62	911.17

编辑：刁力

010-65134912

13621347347

揭香萍

010-87760054

13691427963

杨巍

010-65221981

13681477704

刘航

010-64441854

13810227447

孙宁

010-64441863

13810004143

本周综述

➤ 价格方面，本周，中国铁矿石价格指数微幅震荡，6月24日为190.27，比上周末上升0.47%。

进口矿方面，本周价格微幅上升。6月24日，62%直接进口铁矿石价格为51.54美元/吨，比6月17日上升0.64%，周平均价格为51.30美元/吨；58%直接进口铁矿石价格为43.25美元/吨，比6月24日上升0.46%，周平均价格为43.16美元/吨；62%和58%现货贸易铁矿石价格分别比6月17日上升8.79元/吨和8.03元/吨，升幅为2.14%和2.29%。

国产矿方面，本周价格微幅下降。6月24日，62%国产矿价格为482.05元/吨，比6月17日下降0.47%；65%国产矿价格为506.04元/吨，比6月17日下降0.53%。

➤ 供给方面，据mysteel统计，6月13日-6月19日，北方六大港口铁矿石到港量为1052.3万吨，环比增加293.2万吨。从发货量看，澳大利亚和巴西的发货总量为2234.87万吨，环比增加228.79万吨。其中，澳大利亚发货量为1541.9万吨，环比增加62.6万吨，发往中国1353.6万吨，环比增加176.5万吨；巴西发货量为692.97万吨，环比增加166.19万吨。上周，澳大利亚和巴西的发货量均明显增加。

本周，随着必和必拓在本财年末提升发货水平和力拓港口检修完成，澳大利亚铁矿石发货量会继续增加。巴西方面，随着港口检修的完成，铁矿石发运能力逐渐回升，本周发货量预计有增无减。

➤ 库存方面，本周库存明显增加。6月24日，铁矿石港口库存为10268万吨，比上周末增加211万吨；铁矿石企业库存为4137.2万吨，环比增加148.23万吨。

➤ 需求方面，6月24日，唐山钢厂高炉开工率和产能利用率分别为82.93%和87.27%，比上周末上升31.71个和28.3个百分点。限产结束后，本周，唐山地区钢厂生产迅速恢复，高炉开工率和产能利用率大幅回升，但尚未达到限产前水平。

➤ 本周，铁矿石期货和进口矿价格均微幅上升，周末略有下降。需求方面，唐山地区钢厂在限产结束后生产迅速恢复，但未达到限产前水平，钢厂采购多以按需采购为主，对铁矿石的需求相对稳定。供给方面，近期，澳大利亚和巴西发货量均大幅增加，铁矿石到港量明显上升，港口库存面临较大压力，始终维持在亿吨以上水平。从供求状况来看，近期铁矿石市场供大于求的矛盾加剧，价格面临着较大的下调压力。再加上英国脱欧对除黄金外的国际大宗商品市场的利空影响，预计短期内铁矿石价格易跌难涨。

一周价格：CIOPi 中国铁矿石价格指数

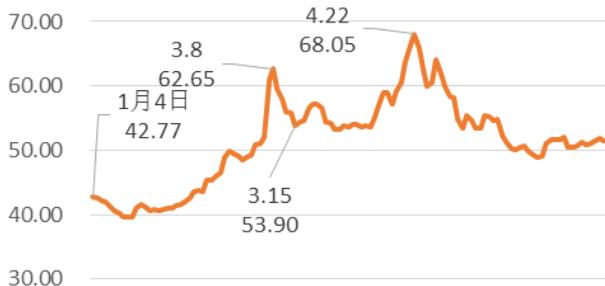
本周 CIOPi 中国铁矿石价格指数走势

日期	6月20日	6月21日	6月22日	6月23日	6月24日
中国铁矿石价格指数	188.01	188.48	189.74	191.29	190.27
进口铁矿会价格指数	188.00	188.67	190.15	192.00	190.82
国产铁矿石价格指数	188.01	187.47	187.53	187.53	187.34

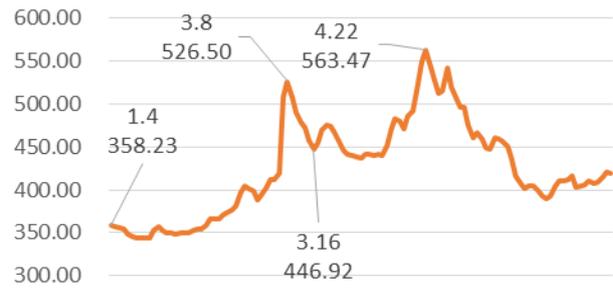
本周 CIOPi 铁矿石价格 (USD / RMB)

日期	62%直进	62%现货	58%直进	58%现货	62%国产	65%国产
6月20日	50.78	407.48	42.67	347.87	483.79	6月20日
6月21日	50.96	408.56	42.81	348.51	482.39	6月21日
6月22日	51.36	414.34	43.32	353.68	482.55	6月22日
6月23日	51.86	420.29	43.76	358.57	482.55	6月23日
6月24日	51.54	419.16	43.25	358.07	482.05	6月24日
平均	51.30	413.97	43.16	353.34	482.67	平均

2016年以来CIOPi62%直进矿价走势 (美元/吨)



2016年以来CIOPi62%现货矿价走势 (元/吨)



2016年以来CIOPi58%直进矿价走势 (美元/吨)



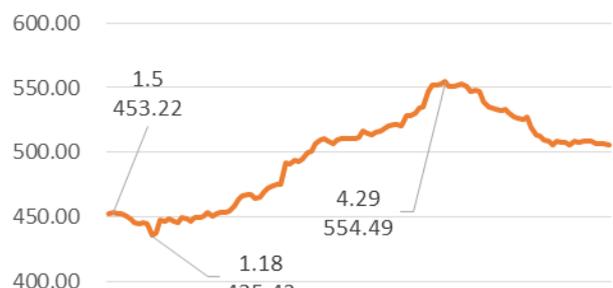
2016年以来CIOPi58%现货矿价走势 (元/吨)



2016年以来CIOPi62%国产矿价走势 (元/吨)



2016年以来CIOPi65%国产矿价走势 (元/吨)

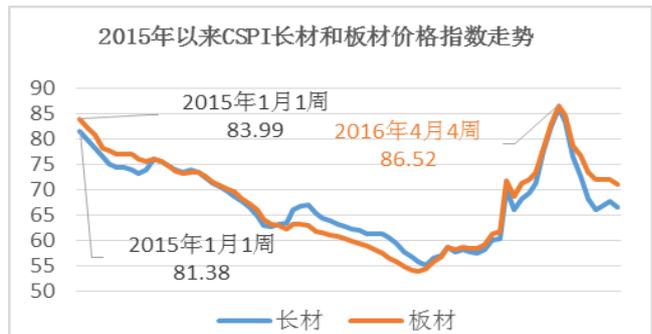


一周价格：CSPI 钢材价格

本周 CSPI 国内市场钢材价格指数

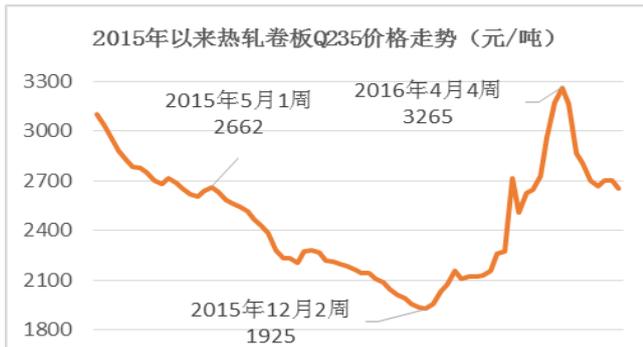
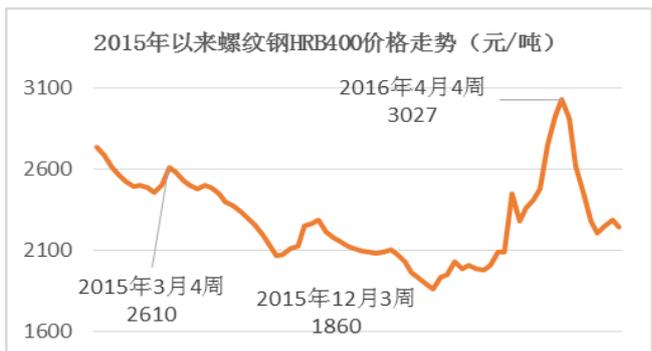
品种	本周	本周比上周	本周比去年底
钢材综合	67.83	-0.97	11.46
长材	66.48	-1.12	9.56
板材	71.12	-0.91	14.33

➤ 本周，CSPI 国内市场钢材价格综合指数为 67.83 点，比上周下降 1.41%；长材指数为 66.48 点，比上周下降 1.66%；板材指数为 71.12 点，比上周下降 1.26%。



本周 CSPI 主要钢材品种分地区价格（元/吨）

品种	全国平均	华北	唐山	东北	沈阳	华东	上海	中南	广州	西南	成都	西北	西安
高线 HPB300 Φ 6.5mm	2391	2438	2470	2323	2260	2377	2400	2372	2430	2440	2380	2370	2210
螺纹钢 HRB400 Φ 16mm	2244	2212	2350	2170	2170	2150	2100	2344	2390	2370	2300	2265	2100
中厚板 Q235 20mm	2436	2244	2260	2383	2310	2391	2340	2470	2450	2735	2650	2465	2410
热轧卷板 Q235 3mm	2650	2574	2540	2500	2450	2670	2600	2688	2640	2805	2670	2595	2640
冷轧薄板 Spcc 1mm	3044	3094	2620	3157	3100	2974	2920	3022	2930	3015	2920	3110	3270
角钢 Q235 5#	2498	2320	2180	2363	2340	2527	2480	2578	2490	2665	2600	2515	2530
镀锌板 SGCC 0.5mm	3907	3873	-	3800	3800	3991	4050	3972	3870	3988	3950	3450	3490
无缝管 20# 219mm×10mm	2899	2810	-	2965	2950	2867	2800	2912	3140	3010	2970	2820	2860



供给数据：铁矿石库存、期货和现货交易平台价格

铁矿石库存变化情况（万吨）

日期	港口库存			企业库存		
	总量	澳大利亚矿	巴西矿	总量	厂内	港口
6月3日	10017	5395	2128	3905.99	1925.79	1980.2
6月13日	10070	5438	2119	3889.03	1872.74	2016.29
6月17日	10057	5494	2108	3988.97	1991.71	1997.26
6月24日	10268	5589	2144	4137.2	2060.99	2076.21

- 据统计，5月，铁矿石进口平均海运费为 15.92 美元/吨。其中，澳大利亚 16.17 美元/吨，巴西 16.97 美元/吨，南非 10.94 美元/吨，印度 17.51 美元/吨，印尼 6.44 美元/吨。

本周大商所铁矿石合约价格（元/吨）

日期	I1609	I1701
6月20日	369.5	342.0
6月21日	374.0	345.5
6月22日	386.5	356.5
6月23日	387.5	357.0
6月24日	385.0	352.5



- 本周，铁矿石期货价格小幅上升。6月24日，I1609 合约价为 385 元/吨，比上周末上升 3.36%；I1701 合约价为 352.5 元/吨，比上周末上升 2.32%。

本周中国铁矿石现货交易平台成交信息

成交日期	交易标的	装港期	成交价格（RMB/USD）	成交数量（t）
2016.6.22	61%PB 粉	7.13-7.22	51.6	170000
2016.6.23	56.7%FMG 超特粉	2016-08（整月）	Platts[NOR-5, NOR+5], 62%, (88%)	188000

- 本周，中国铁矿石现货交易平台共申报 55 笔、586.39 万吨，共成交 2 笔、35.8 万吨。
- 6月24日，COREX62%铁矿石现货交易基准价为 52.4 美元/吨，月均价格为 51.33 美元/吨；58%铁矿石现货交易基准价为 42.96 美元/吨，月均价格为 42 美元/吨。

本周 Global ORE 现货交易平台交易动态

成交日期	交易标的	成交数量（t）	船期	成交价格（USD）
6月21日	IOcJ	90000	7月到港	55.25
6月22日	纽曼粉	90000	8月到港	52.4
6月22日	PB 粉	170000	8月到港	52.45
6月24日	金布巴粉	80000	8月到港	49.85

供给数据：海运费和相关商品价格行情

本周 BDI 和海运费价格（美元/吨）

日期	BDI	BCI	西澳—青岛	巴西图巴朗—青岛
6月20日	582	897	4.418	8.727
6月21日	580	873	4.309	8.755
6月22日	585	878	4.332	8.991
6月23日	596	897	4.336	9.268
6月24日	609	913	4.336	9.323



➤ 6月24日，BDI 报收 609，比上周末上升 3.75%；BCI 为 913，比上周末下降 1.51%。

本周相关商品价格行情

日期	环渤海动力煤价格指数 (元/吨)	布伦特原油期货结算价 (美元/桶)	主焦煤 长治出厂含税价 (元/吨)	二级冶金焦 (A13S0.7) 长治出厂含税价 (元/吨)	废钢 上海重庆 (元/吨)	方坯 Q235 唐山出厂含税价 (元/吨)
6月20日	400.00	50.65	600-630	800	1040-1090	1790
6月21日	400.00	50.62	600-630	800	1040-1090	1810
6月22日	400.00	49.88	600-630	780	1060-1110	1820
6月23日	400.00	50.91	600-630	780	1090-1140	1830
6月24日	400.00	48.41	600-630	780	1110-1160	1840

本周钢材、焦炭、焦煤期货主力合约价格（元/吨）

日期	螺纹钢 RB1610	热轧板卷 HC1610	焦炭 J1609	焦煤 JM1609
6月20日	2062.0	2237.0	845.5	668.0
6月21日	2082.0	2260.0	842.5	677.5
6月22日	2143.0	2314.0	872.0	701.5
6月23日	2141.0	2307.0	877.0	708.0
6月24日	2126.0	2297.0	880.5	705.5

本周其他铁矿石价格指数

日期	CIOPI		普氏		TSI		CSI	Mysteel
	62%直进	58%直进	62%	58%	62%	58%	62%进口粉矿	62%澳大利亚粉矿
6月20日	50.78	42.67	51.00	38.95	50.06	43.10	49.20	51.15
6月21日	50.96	42.81	51.00	38.95	50.70	43.10	49.20	51.05
6月22日	51.36	43.32	52.90	40.65	51.70	43.20	49.80	52.30
6月23日	51.86	43.76	52.50	40.25	51.70	43.20	50.10	52.30
6月24日	51.54	43.25	52.00	39.75	51.40	43.20	49.70	51.60

供给侧资讯

➤ BHP 预计铁矿石供应过剩还将持续 10 年

必和必拓近日表示，预期全球铁矿石市场至少还将经历 10 年的供应过剩，之后市场才能达到平衡。

必和必拓 CEO Andrew Mackenzie 表示，海运铁矿石将是花费最长时间企稳的大宗商品之一，虽然价格已从历史低位有所恢复并在 5 月初升至 60 美元/吨关口之上，但涨势是不可持续的。“我们已经经历了如此长的繁荣时期。要走出低谷，在我看来至少还得用 10 年。”

➤ 力拓恰那铁矿因安全事故停产

力拓 6 月 20 日表示，恰那铁矿该日停产。该铁矿有一名 32 岁矿工遇难，目前恰那铁矿正在全力配合警方调查，何时复产仍不得知。该铁矿由力拓和中钢共同持有，双方分别占有 60% 和 40% 的股份。

2016 年 4 月 15 日，力拓与中钢宣布，双方将再次延续位于西澳大利亚皮尔巴拉地区的恰那铁矿合营项目。通过恰那合营项目再延期及额外的市场协议，未来五年内，力拓将向中钢提供最多 7000 万吨的产自皮尔巴拉的铁矿石。

➤ 力拓换帅 业务价格面临再调整

力拓集团 6 月 21 日宣布，由于该公司现任 CEO 山姆·威尔士 (Sam Walsh) 将于 7 月 1 日退休，新任 CEO 夏思杰 (Jean-Sébastien Jacques) 将于 7 月 2 日履新。

夏思杰还宣布，将从 7 月 2 日起对力拓的业务架构进行再调整，以更好地提升资产经营的战略和效率。新的业务架构将包括四个板块，铝；铜和钻石；能源、煤矿以及铁矿石。

➤ 传闻淡水河谷计划出售巴西铁矿石资产

近日有媒体报道，巴西淡水河谷计划出售其巴西铁矿石资产少数权益。这项交易可能为其带来 70 亿美元现金。

根据彭博社报道，淡水河谷正在与亚洲的矿业公司讨论上述出售事宜。目前，淡水河谷尚未达成任何协议，谈判也可能没有结果。

淡水河谷矿产品 (中国) 有限公司相关人士表示，淡水河谷对此不作评论。

需求侧数据：钢铁产量、高炉开工率和钢材库存

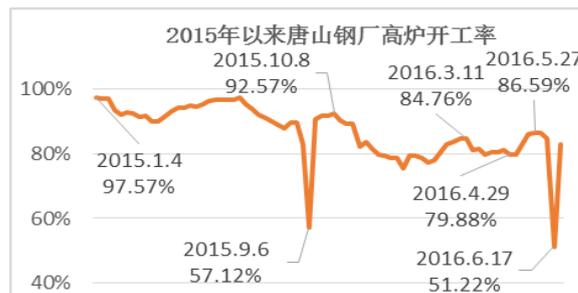
重点企业旬度粗钢、生铁、钢材日产量（万吨）

日期	粗钢	环比	生铁	环比	钢材	环比
5月上旬	170.96	-0.56%	166.73	0.80%	163.82	-5.42%
5月中旬	174.58	2.23%	167.95	0.73%	167.41	2.19%
5月下旬	177.77	103.98%	165.19	-1.64%	172.87	3.26%
6月上旬	174.16	-2.03%	170.57	3.26%	162.59	-5.95%

➤ 6月上旬，钢协会员钢企日产粗钢 174.16 万吨，比上期减少 3.61 万吨，降低 2.03%。据此估算，本旬全国日产粗钢 234.75 万吨，比上期降低 1.59%。

近期唐山钢厂高炉开工率

日期	开工率	产能利用率
6月3日	86.59%	91.34%
6月12日	84.76%	89.98%
6月17日	51.22%	58.97%
6月24日	82.93%	87.27%



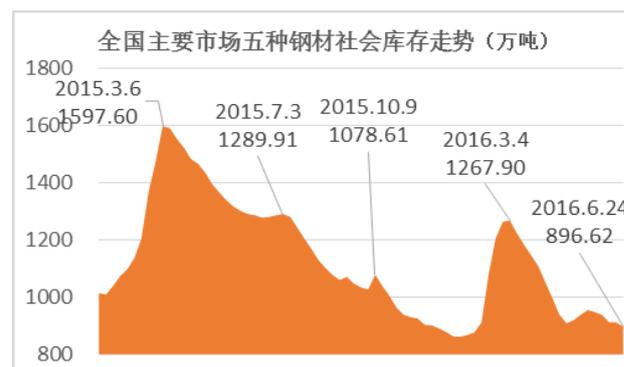
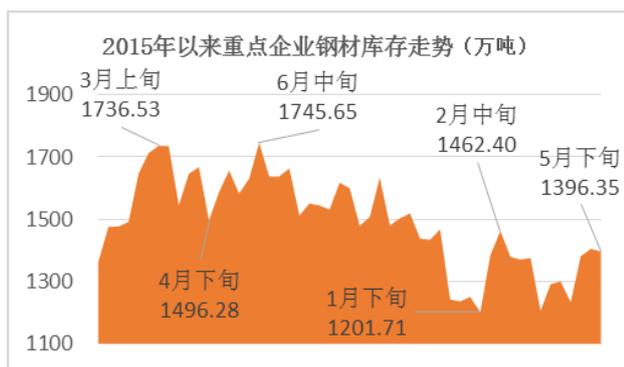
➤ 6月24日，唐山钢厂高炉开工率和产能利用率分别为 82.93% 和 87.27%，分别比上周末上升 31.71 个和 28.3 个百分点。

重点大中型企业钢材库存（万吨）

日期	库存量	环比
5月上旬	1381.55	11.96%
5月中旬	1404.72	1.68%
5月下旬	1396.35	-0.60%
6月上旬	1420.06	1.70%

全国主要市场五种钢材社会库存（万吨）

日期	库存量	环比
6月3日	937.87	-0.97%
6月12日	911.36	-2.83%
6月17日	911.17	-0.02%
6月24日	896.62	-1.60%



➤ 6月24日，全国主要市场五种钢材社会库存为 896.62 万吨，比上周末下降 1.60%。其中，螺纹钢库存为 388.72 万吨，比上周末下降 4.40%；线材库存为 110.07 万吨，比上周末下降 0.18%；热轧库存为 188.30 万吨，比上周末上升 1.58%；中厚板库存为 87.50 万吨，比上周末上升 0.78%；冷轧库存为 122.03 万吨，比上周末下降 0.05%。

需求侧资讯

➤ 5月全球粗钢产量 1.39 亿吨 同比下降 0.1%

5月，全球66个纳入世界钢铁协会统计国家或地区的粗钢产量为1.39亿吨，同比下降0.1%；粗钢产能利用率为71.3%，同比下降1.0个百分点，环比下降0.1个百分点。

单位：千吨	5月	同比增长	1月-5月	同比增长
欧盟28国	14481	-5.5%	68854	-6.4%
欧洲其他地区	3305	6.1%	14682	2.8%
独联体6国	8904	1.0%	42757	-0.7%
北美	9590	-0.8%	46216	-0.7%
南美	3302	-13.7%	15805	-14.8%
非洲	1023	-10.6%	4949	-19.0%
中东	2500	-0.4%	11462	-3.0%
亚洲	95612	1.3%	451344	-1.4%
大洋洲	436	-17.9%	2158	-7.8%
全球66国（地）	139154	-0.1%	658227	-2.2%
中国大陆	70504	1.8%	329950	-1.4%

➤ 宝钢武钢将合并 诞生全球第二大钢厂

宝钢股份和武钢股份6月26日下午分别发布公告称，武钢集团与宝钢集团有限公司正在筹划战略重组事宜，重组方案尚未确定，方案确定后尚需获得有关主管部门批准。

2015年宝钢粗钢产量为3494万吨，排名中国第二，全球第五；武钢粗钢产量为2578万吨，排名中国第六，全球第九。宝钢武钢合并后的产量为6072万吨，超过河钢跃居中国第一，全球第二位。

➤ 山东一批钢铁企业面临关停搬迁

根据日前发布的《山东省2013~2020年大气污染防治规划二期行动计划（2016~2017年）》（以下简称《二期行动计划》），山东加大产业结构调整力度，加快核心控制区污染大气环境的生产项目搬迁，对达不到环境管理要求的项目分别采取限产整治、停产整治、停止建设等措施，要求临沂三德特钢、江鑫钢铁等一批钢铁冶金企业的生产线，在2017年底前完成搬迁关停。

在《二期行动计划》列出的重点项目清单中，明确列出了2016年关闭的落后产能淘汰（过剩产能压缩）项目，以及在2017年完成的重污染钢铁企业环保搬迁、改造项目。今年内将关闭的产能包括淄博宝塔焦化公司的60万吨焦炉及其回收设施、山东潍焦集团薛城能源公司80万吨炼焦炉等设备。根据《二期行动计划》，2017年，山东将有十余家钢铁冶金企业的生产线和主要设备面临关停搬迁。主要包括：山钢莱钢集团烟台钢管公

司的钢管生产线搬迁至烟台福山区，实施除尘、脱硫、脱硝改造；搬迁关停临沂三德特钢公司的5台630立方米高炉、3台60吨转炉、360万吨产能，临沂江鑫钢铁公司的2台508立方米高炉、120万吨产能，山东盛阳铁合金公司的450立方米高炉、30万吨产能，临沂宇光钢铁公司的450立方米高炉、90平米烧结机、40万吨产能，山东山威集团公司的2台450立方米高炉、2台90平米烧结机、80万吨产能，山东元生铸冶公司的128立方米高炉、90平米烧结机、15万吨产能，临沂山威铸冶公司的128立方米高炉、90平米烧结机、10万吨产能。

➤ 钢铁等行业利润呈明显恢复性增长

国家统计局6月27日发布的工业企业财务数据显示，1月-5月，规模以上工业企业利润同比增长6.4%，增速比1月-4月回落0.1个百分点。其中，5月，利润同比增长3.7%，增速比4月回落0.5个百分点。总体看，5月工业企业利润增速虽然小幅回落，但工业企业效益继续呈现积极变化。

其中，煤炭、钢铁、有色等行业利润呈明显恢复性增长。受前期产品价格回升、结构改善和同期基数偏低的影响，5月，煤炭开采业利润同比增长2.5倍，结束了近年来持续下降的状态；黑色金属冶炼和压延加工业利润同比增长1.6倍，有色金属冶炼和压延加工业增长32.1%，均延续了4月以来快速增长的趋势。

➤ 前五月国企利润同比下降9.6% 钢铁仍亏损

6月24日财政部公布的数据显示，1月-5月，全国国有及国有控股企业收入、利润同比继续下降，营业总收入同比下降0.6%，利润同比下降9.6%。其中，煤炭、钢铁和有色等行业继续亏损。

而在6月24日举办的2016年中国钢铁金融衍生品国际大会上，中国钢铁工业协会副会长王利群表示，1月-4月，大中型钢铁企业整体扭亏为盈，实现利润总额0.64亿元。

➤ 美国推迟发布对华碳合金钢定尺板反补贴初裁

6月17日，美国商务部发布公告，将对中国和韩国的碳合金钢反补贴调查初裁时间从2016年7月5日推迟至2016年9月6日。

2016年4月29日，美国商务部发布对中国、韩国和巴西的碳合金钢定尺板发起反补贴立案调查的公告。