



## 关于太钢外销铁矿价格的通知 ( 2020 年第 039 号 )

根据目前铁矿市场行情，结合我公司生产经营情况，现对 2020 年 10 月 19 日-10 月 25 日出厂铁矿价格公布如下：

1、岚县赤铁精矿

品质及粒度：TFe: 65.5%; SiO<sub>2</sub>: 3.5 %; Al<sub>2</sub>O<sub>3</sub>: 1.0 %; S: 0.02%; P: 0.035%;  
粒度：325 目为 85%；比表面积：2310cm<sup>2</sup>/g

提货地点：岚县普明球团厂

付款方式：现汇

价格：947 元/吨，干基不含税车板价，火车/汽车自提

2、岚县磁铁精矿

品质及粒度：TFe: 65.5%; FeO: 19.0%; SiO<sub>2</sub>: 7.5 %; Al<sub>2</sub>O<sub>3</sub>: 1.0 %; S: 0.02%; P: 0.035%; 粒度：325 目为 85%；比表面积：2310cm<sup>2</sup>/g

提货地点：岚县田野选矿厂

付款方式：现汇

价格：867 元/吨，干基不含税车板价，汽车自提

3、岚县赤铁精矿每笔订单量小于 3000 吨且不能每周连续订货，在当周价格基础上加价 10 元/吨，由于太钢原因不能订货不适用该加价。

4、除上述一口价销售模式外，还可向客户提供基差交易模式进行采购，详见基差交易模式操作流程附件。

5、客户一个价格周期内超 15000 吨部分实行优惠价结算：大于 15000 吨小于等于 40000 吨部分优惠 5 元/吨；大于 40000 吨小于等于 60000 吨部分优惠 10 元/吨；大于 60000 吨部分优惠 15 元/吨；

6、对于采用点价采购的客户每吨优惠 5 元/吨；

7、客户只能选择第 5 条和第 6 条中的其中一项优惠；

8、本通知解释权归太原钢铁（集团）国际经济贸易有限公司。

附件：太钢铁矿基差交易操作流程

联 系 人：宁先生

联系电话：(0351) 2131089, 13934612065

E-mail: ningfh@tisco.com.cn

太原钢铁（集团）国际经济贸易有限公司

2020 年 10 月 19 日



## 基差交易模式操作流程（试行）

购销双方在确定现货买卖时，先确定价格公式，暂不确定最终价格。价格公式：“**最终结算价=期货合约价+基差**”。购销双方在签订买卖合同时，先确定基差，买方可在点价期内（如 60 日），选择认为合适的期货盘面价进行点价，通过“**期货盘面价+基差**”确定最终价格。

### 第一步：结合大连商品交易所铁矿石期货合约确定基差

例：2019 年 8 月 26 日，太钢公布当周铁精矿销售价格为 730 元/吨（干基不含税），同日大连商品交易所铁矿石期货合约 I2001 合约上午 11:30 收盘价格为 600 元/吨（干基含税），当日签订合同的基差为  $730 - 600 \div 1.13 = 199.03$  元/吨。

### 第二步：客户与太钢签署点价采购合同

### 第三步：客户向太钢支付点价保证金（合同货值的 15%）

以合同数量 5000 吨为例，按照临时价[太钢公布的当周铁精矿销售价格为 730 元/吨（干基不含税），对应干基含税价格为  $730 \times 1.13 = 824.9$  元/吨]，点价保证金比例为 15%，即点价保证金金额为  $5000 \times 824.9 \times 15\% = 618675$  元。

### 第四步：客户按照临时价付款提货，结算比例 80%

供应商按太钢公布的当周铁精矿销售价格付款（以干基不含税 730 元/吨为例） $730 \times 1.13$ （增值税率）=824.9 元/干吨，太钢向客户转移货权，并安排为客户装车提货。

### 第五步：在点价期内选择分批或一次点价（合同签署约定）

如 2019 年 8 月 27 日，在盘面价格下降到 580 元，客户进行点价，太钢也按照此价格在盘面上成交，则客户此批铁精矿最终结算价格= $580 / 1.13 + 199.03$ （基差）=712.3 元/吨（干基不含税），比用固定价采购降低成本  $713.2 - 730 = -16.8$  元/吨

**第六步：点价完成后根据确定的最终价格（点价价格+基差）进行尾款结算，货款多退少补。**

本操作流程解释权归太原钢铁（集团）国际经济贸易有限公司；同时根据业务开展情况，太原钢铁（集团）国际经济贸易有限公司对本操作流程保留动态调整的权利。