

山金期货黑色板块日报

更新时间：2022年08月03日08时47分

螺纹、热卷

数据类别	指标	单位	最新	较上日		较上周	
期现货价格	螺纹钢主力合约收盘价	元/吨	4093	97	2.43%	234	6.06%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4042	73	1.84%	185	4.80%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	4170	120	2.96%	270	6.92%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	4030	80	2.03%	180	4.68%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	77	23		36	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-12	7		-5	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	175	31		58	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	97	13		26	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	51	5		0	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	50	-6		10	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-226	-36		-58	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-147	-7		-36	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	27	18		-5	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	28	29		-15	
中厚板材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	4620	0	0	250	5.72%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4670	10	0.21%	120	2.64%
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4450	0	0	110	2.53%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3760	0	0	210	5.92%
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2520	0	0	240	10.53%
钢厂高炉生产及盈利情况 (周度)	247家钢厂高炉开工率	%	73.16	——		-3.82	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	219.24	——		-7.02	-3.10%
	盈利钢厂比例	%	19.05	——		9.09	
产量 (周度)	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	232.37	——		2.08	0.90%
	热卷产量	万吨	304.07	——		-2.60	-0.85%
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	产能利用率	%	37.6	——		4.21	
	开工率	%	49.09	——		4.02	
	电炉钢厂螺纹钢产量	万吨	48.96	——		1.51	3.17%
库存 (周度)	五大品种社会库存	万吨	1321.57	——		-58.33	-4.23%
	螺纹社会库存	万吨	641.89	——		-40.77	-5.97%
	热卷社会库存	万吨	282.75	——		-2.87	-1.00%
	五大品种钢厂库存	万吨	514.42	——		-54.06	-9.51%
	螺纹钢厂库存	万吨	243.97	——		-37.78	-13.41%
	热卷钢厂库存	万吨	82.8	——		-7.35	-8.15%
	唐山地区钢坯库存	万吨	119.98	——		6.94	6.14%
现货市场成交	全国建筑钢材成交量 (7天移动均值, 钢银)	万吨	12.92	-3.22	-19.96%	-2.93	-18.49%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	10200	——		1600	18.60%
期货仓单	螺纹钢注册仓单数量	吨	7209	0		-6900	
	热卷注册仓单数量	吨	1182	0		592	
基本面概述	近期钢材价格快速反弹, 但现货市场成交并未明显扩大, 显示市场追高意愿不足。短期由于钢厂亏损情况有所改善, 螺纹钢产量上升较快, 同时成本也出现上涨。目前处于暑期消费淡季, 且7月的地产数据显示房企的投资仍处低位, 中期需求仍低迷, 近期表观需求改善的持续性有待观望。从技术面看, 期价突破布林带中轨阻力后继续上升, 但上方有前期低点构成的阻力, 继续上涨难度较大。						
操作建议	维持观望。目前行情维持宽幅震荡概率大, 中线谨慎操作, 短线可高抛低吸						

铁矿石

数据类别	指标	单位	最新	较上日		较上周	
期现货价格	麦克粉 (青岛港)	元/湿吨	770	10	1.32%	71	10.16%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	744	9	1.22%	54	7.83%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	787	5.0	0.64%	76.0	10.69%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	115.48	-3.65	-3.06%	15.99	16.07%
	普氏62%指数	美元/干吨	112.9	-1.10	-0.96%	8.90	8.56%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-17	5.0		-5.0	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-43	4.0		-22.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	67	0		30.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	13	0		-1.0	
	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	128	3	2.40%	25	24.27%

品种价差	纽曼块粉价差 (日照港)	元/湿吨	104	4	4.00%	5	5.05%
	卡拉加斯粉-PB粉 (日照港)	元/吨	114	17	17.53%	5	4.59%
	PB-超特粉 (日照港)	元/吨	123	-10	-7.52%	24	24.24%
	普氏65%-62%	美元/干吨	11.1	0.10			-0.40
	普氏62%-58%	美元/干吨	16.05	0.05			4.55
海外铁矿石发货量 (周度)	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1562.1	—		-106.8	-6.40%
	巴西铁矿石发货量	万吨	804.4	—		234.1	41.05%
海运费与汇率	BCI运价: 西澳-青岛	美元/吨	9.88	0.02	0.20%	-1.19	-10.75%
	BCI运价: 图巴朗-青岛	美元/吨	26.2	-0.35	-1.32%	-4.47	-14.57%
	美元指数		106.3479	0.9355	0.89%	-0.8784	-0.82%
	美元兑人民币即期		6.75	-0.0175	-0.26%	-0.0149	-0.22%
铁矿石到港量与疏港量 (周度)	北方六港到货量合计	万吨	936.1	—		-273.4	-22.60%
	日均疏港量 (45港口合计)	万吨	259.842	—		-0.87	-0.33%
铁矿石库存 (周度)	港口库存合计	万吨	13534.55	—		340.00	2.58%
	港口贸易矿库存	万吨	7904.45	—		146.78	1.89%
	进口矿烧结粉矿总库存: 64家样本钢厂	万吨	1324.85	—		-24.77	-1.84%
国内部分矿山铁矿石产量	全国样本矿山铁精粉产量 (186座)	万吨/日	50.58	—		0.36	0.72%
期货仓单	数量	张	1600	0		100	
基本面概述	随着终端产品价格快速上涨, 近期钢厂即期亏损情况有所改善, 钢厂产量水平上升, 对铁矿石的需求也随之改善。由于目前钢厂库存水平较低, 补库需求推动铁矿石价格出现反弹。库存方面, 港口库存及贸易矿的库存继续上升。发运量有所上升, 到港量有所回落。从供求角度看, 目前处于港口阶段性累库、供应边际宽松的状态。短期来看, 随着钢价的企稳, 钢厂过度去库后可能会造成集中补库带动价格出现强势反弹, 但长期的下行趋势理应有改变						
操作建议	行情进入宽幅震荡, 建议维持观望						

铁矿石现货品牌价格 (元/湿吨)

2022/8/3

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	797	+7	797	+7	806	+7	814	+7	804	+5	801	+6	812	+5
卡拉加斯粉	910	+6	910	+6	923	0	932	+7	923	0	918	+6	930	+17
巴混63.0%	857	+7	857	+7	862	+5	879	+7	862	+5	857	+7	889	+24
巴混62.5%	837	+7	837	+7	842	+5	859	+7	842	+5	837	+7	874	+24
纽曼粉	807	+7	811	+6	815	+5	830	+7	815	+5	811	+6	832	+5
麦克粉	774	+4	778	+4	785	+4	787	+12	785	+4	783	+14	790	+11
金布巴粉60.5%	757	+13	757	+13	771	-2	766	+13	771	-2	757	+9	774	+9
金布巴粉59.5%	741	+13	741	+13	761	-2	756	+13	761	-2	741	+13	754	+9
罗伊山粉	772	+7	772	+7	769	+5	776	+7	769	+5	—	—	777	+5
IOC6	755	-20	770	-5	784	+5	799	+7	784	+5	770	-5	789	+5
FMG混合粉	727	+1	727	+1	725	0	725	0	725	0	727	+1	745	+10
超特粉	669	+4	667	0	679	-1	684	0	678	-2	—	—	688	+3
杨迪粉	784	+13	784	+13	767	0	766	0	767	0	784	13	775	+10
卡拉拉精粉	1060	+10	1060	+10	—	—	1051	+7	—	—	—	—	1030	+20
乌克兰精粉	1155	0	—	—	1024	0	—	—	1024	0	1090	+10	—	—
KUMBA	920	+10	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

铁矿石港口现货与DCE期货主力价差 (元/吨)

 DCE铁矿石主力最新价 **788.0**

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	9	9	18	26	16	13	24
卡拉加斯粉	122	122	135	144	135	130	142
麦克粉	-14	-10	-3	-1	-3	-5	2
金布巴粉60.5%	-31	-31	-17	-22	-17	-31	-14
金布巴粉59.5%	-47	-47	-27	-32	-27	-47	-34
罗伊山粉	-16	-16	-19	-12	-19	—	-11
IOC6	-33	-18	-4	11	-4	-18	1
FMG混合粉	-61	-61	-63	-63	-63	-61	-43
超特粉	-119	-121	-109	-104	-110	—	-100
杨迪粉	-4	-4	-21	-22	-21	-4	-13
卡拉拉精粉	272	272	—	263	—	—	242
乌克兰精粉	367	—	236	—	236	302	—
KUMBA	132	—	—	—	—	—	—

备注: 1.现货与DCE期货主力的价差没有进行干/湿吨的换算

产业资讯

【工信部：严格执行产能置换政策】重点做好三方面工作：一是要着力推动钢铁工业稳增长。二是要着力向发展质量要效益。三是要严格执行产能置换政策。行业和企业应当自觉做行业秩序的维护者，切实严禁新增产能，巩固好去产能成果。

【工信部：对钢铁、石化化工、建材、有色金属冶炼等行业开展工业节能监察工作】工信部办公厅开展2022年工业节能监察工作，对钢铁、石化化工、建材、有色金属冶炼等行业企业开展强制性单位产品能耗限额标准执行情况专项监察。在2021年工作基础上，对钢铁、焦化、铁合金、水泥（有熟料生产线）、电解铝以及炼油、乙烯、对二甲苯、现代煤化工（煤制甲醇、煤制烯烃、煤制乙二醇）、合成氨、电石、烧碱、纯碱、磷铵、黄磷、平板玻璃、建筑和卫生陶瓷、有色金属（铜冶炼、铅冶炼、锌冶炼）行业企业开展全面节能监察。

作者：朱美侠
期货从业资格证号：F3049372
投资咨询从业资格证号：Z0015621
电话：021-20627563
邮箱：zhumeixia@sd-gold.com

审核：曹有明
期货从业资格证号：F3038998
投资咨询从业资格证号：Z0013162
电话：021-20627258
邮箱：caoyouming@sd-gold.com

免责声明：

本报告由山金期货投资咨询部制作，未获得山金期货有限公司的书面授权，任何人和单位不得对本报告进行任何形式的修改、发布和复制。本报告基于本公司期货研究人员采用可信的公开资料和实地调研资料，但本公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，且本报告中的资料、建议、预测均反映报告初次发布时的判断，可能会随时调整，报告中的信息或所表达的意见不构成投资、法律、会计或税务的最终操作建议，本公司不就报告中的内容对最终操作建议作任何担保。在山金期货有限公司及其研究人员知情的范围内，山金期货有限公司及其期货研究人员以及财产上的利害关系人与所评价或推荐的产品不存在任何利害关系，同时提醒期货投资者，期市有风险，入市须谨慎。