

山金期货黑色板块日报

更新时间：2022年08月04日08时31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	4063	-41	-1.00%	147	3.75%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4020	-33	-0.81%	146	3.77%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	4160	10	0.24%	240	6.12%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	4020	-10	-0.25%	170	4.42%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	97	51		93	
	热轧卷板主力基差	元/吨	0	23		24	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	153	-22		25	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	90	-7		26	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	50	-1		6	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	56	6		9	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-203	23		-31	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-146	1		-35	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	20	-7		-2	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	14	-14		-5	
中厚板材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	4600	-20	-0.43%	220	5.02%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4670	0	0	120	2.64%
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4480	30	0.67%	160	3.70%
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	220	9.57%
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	12.25	-3.31	-21.28%	-4.64	-27.48%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	10200	——		1600	18.60%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	7209	0		0	
	热卷注册仓单数量	吨	1182	0		592	
基本面概述	从最新的供求数据看, 建材产量大幅上升, 库存继续下降, 长、短流程钢厂利润均出现改善, 但钢厂复产偏谨慎, 铁水产量恢复速度较慢。由于现货市场受制于暑期的消费淡季, 成交活跃度不高, 市场追涨意愿不足。房地产企业土地购置面积及新开工面积同比维持大幅回落态势, 中远期需求不足的担忧仍在。从技术面看, 期价突破布林带中轨阻力后上升速度放缓, 显示上方存在很强的阻力。						
操作建议	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	751	-23	-2.97%	23	3.16%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	737	-20	-2.64%	32	4.54%
	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	109.93	-4.74	-4.13%	4.50	4.27%
	普氏62%指数	美元/干吨	108.1	-5.20	-4.59%	-2.95	-2.66%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-36	-28.0		-53.0	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-50	-25.0		-44.0	
	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	143	15	11.72%	43	43.00%

品种价差	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	123	19	18.27%	37	43.02%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	119	6	5.31%	-3	-2.46%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	112	-18	-13.85%	-5	-4.27%
	普氏65%-62%	美元/干吨	16.7	5.20		6.20	
	普氏62%-58%	美元/干吨	10.8	-5.20		-2.25	
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	9.71	-0.17	-1.72%	-0.73	-6.99%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	25.59	-0.61	-2.33%	-3.69	-12.60%
	美元指数		106.3676	0.0197	0.02%	-0.0874	-0.08%
	美元兑人民币即期		6.7597	0.0097	0.14%	-0.0003	-0.00%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1154.6	—		218.5	23.34%
	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	由于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，但是钢厂库存水平较低，市场预期补库需求将提振价格。海运方面，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，虽然价格出现了较为明显的反弹，但或许已经充分反映了市场对于补库需求的预期。而目前钢厂对未来的判断维持谨慎，在价格反弹之后的高位，大量并且集中的补库行为或不会出现，后市或存在一定的下行压力。						
操作建议	行情维持宽幅震荡概率大，建议维持观望						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2022/8/4

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	770	-27	771	-26	776	-30	794	-20	775	-29	772	-29	790	-22
卡拉加斯粉	890	-20	890	-20	903	-20	912	-20	903	-20	898	-20	910	-20
巴混63.0%	830	-27	831	-26	833	-29	859	-20	833	-29	831	-26	867	-22
巴混62.5%	810	-27	811	-26	813	-29	839	-20	813	-29	811	-26	852	-22
纽曼粉	787	-20	786	-25	787	-28	810	-20	788	-27	786	-25	810	-22
麦克粉	751	-23	750	-28	760	-25	780	-7	759	-26	753	-30	768	-22
金布巴粉60.5%	737	-20	737	-20	746	-25	746	-20	746	-25	737	-20	750	-24
金布巴粉59.5%	721	-20	721	-20	736	-25	736	-20	736	-25	721	-20	730	-24
罗伊山粉	745	-27	746	-26	740	-29	756	-20	740	-29	—	—	755	-22
IOC6	745	-10	744	-26	755	-29	779	-20	755	-29	744	-26	770	-19
FMG混合粉	714	-13	717	-10	723	-2	723	-2	722	-3	717	-10	737	-8
超特粉	656	-13	659	-8	667	-12	673	-11	667	-11	—	—	677	-11
杨迪粉	758	-26	758	-26	764	-3	755	-11	764	-3	765	-19	750	-25
卡拉拉精粉	1045	-15	1045	-15	—	—	1031	-20	—	—	—	—	1010	-20
乌克兰精粉	1140	-15	—	—	1004	-20	—	—	1004	-20	1075	-15	—	—
KUMBA	905	-15	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

铁矿石粉矿港口现货与DCE期货主力价差（元/吨）

DCE铁矿石主力最新价 771.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	-1.5	-0.5	4.5	22.5	3.5	0.5	18.5
卡拉加斯粉	118.5	118.5	131.5	140.5	131.5	126.5	138.5
麦克粉	-20.5	-21.5	-11.5	8.5	-12.5	-18.5	-3.5
金布巴粉60.5%	-34.5	-34.5	-25.5	-25.5	-25.5	-34.5	-21.5
金布巴粉59.5%	-50.5	-50.5	-35.5	-35.5	-35.5	-50.5	-41.5
罗伊山粉	-26.5	-25.5	-31.5	-15.5	-31.5	—	-16.5
IOC6	-26.5	-27.5	-16.5	7.5	-16.5	-27.5	-1.5
FMG混合粉	-57.5	-54.5	-48.5	-48.5	-49.5	-54.5	-34.5
超特粉	-115.5	-112.5	-104.5	-98.5	-104.5	—	-94.5
杨迪粉	-13.5	-13.5	-7.5	-16.5	-7.5	-6.5	-21.5
卡拉拉精粉	273.5	273.5	—	259.5	—	—	238.5
乌克兰精粉	368.5	—	232.5	—	232.5	303.5	—
KUMBA	133.5	—	—	—	—	—	—

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

中国炼焦行业协会发布《焦化行业碳达峰碳中和行动方案》提出，到2025年焦化废水产生量减少30%，氮氧化物和二氧化硫产生量分别减少20%。

【中国12家钢企上榜2022年财富世界500强】8月3日，2022年财富世界500强榜单发布。据统计，中国钢铁企业有12家入围世界500强，分别是中国宝武钢铁集团有限公司、河钢集团有限公司、鞍钢集团有限公司、青山控股集团有限公司、江苏沙钢集团有限公司、首钢集团有限公司、山东钢铁集团有限公司、杭州钢铁集团有限公司、北京建龙重工集团有限公司、敬业集团有限公司、湖南钢铁集团有限公司和上海德龙钢铁集团有限公司。其中，杭州钢铁集团有限公司、湖南钢铁集团有限公司和上海德龙钢铁集团有限公司首次进入榜单。

【中国宝武首次进世界500强前50】中国宝武钢铁集团有限公司继去年首次进入前百强后，今年首次挺进前50强，以营业收入150730百万美元排名第44位，较上一年跃升28位，继续位居全球钢铁企业首位。

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。