

山金期货黑色板块日报

更新时间：2022年08月09日08时17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	4136	100	2.48%	43	1.05%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4099	94	2.35%	57	1.41%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	4210	70	1.69%	40	0.96%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	4060	70	1.75%	30	0.74%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	74	-30		-3	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-39	-24		-27	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	149	-24		5	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	91	-10		7	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	59	15		13	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	68	7		12	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-208	9		-18	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-159	3		-19	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	21	-20		12	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	12	-12		13	
中厚板线材冷轧价格	热卷10-螺纹10价差	元/吨	-37	-6		14	
	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	4640	80	1.75%	20	0.43%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4680	30	0.65%	20	0.43%
钢坯及废钢价格	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4490	50	1.13%	40	0.90%
	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3760	50	1.35%	0	0
钢厂高炉生产及盈利情况 (周度)	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2540	50	2.01%	20	0.79%
	247家钢厂高炉开工率	%	71.61	——		-1.55	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	213.58	——		-5.66	-2.58%
产量 (周度)	盈利钢厂比例	%	41.99	——		22.94	
	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	245.59	——		13.22	5.69%
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	热卷产量	万吨	299.96	——		-4.11	-1.35%
	产能利用率	%	42.91	——		5.31	
	开工率	%	56.34	——		7.25	
库存 (周度)	电炉钢厂螺纹钢产量	万吨	48.96	——		1.51	3.17%
	五大品种社会库存	万吨	1273.27	——		-48.30	-3.65%
	螺纹社会库存	万吨	603.03	——		-38.86	-6.05%
	热卷社会库存	万吨	279.35	——		-3.40	-1.20%
	五大品种钢厂库存	万吨	475.76	——		-38.66	-7.52%
	螺纹钢厂库存	万吨	216.32	——		-27.65	-11.33%
	热卷钢厂库存	万吨	81.45	——		-1.35	-1.63%
现货市场成交	唐山地区钢坯库存	万吨	119.1	——		-0.88	-0.73%
	全国建筑钢材成交量 (7天移动均值, 钢银)	万吨	11.60	-2.42	-17.26%	-4.54	-28.13%
期货仓单	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	10800	——		600	5.88%
	螺纹注册仓单数量	吨	9013	1804		1804	
基本概述	热卷注册仓单数量	吨	17131	0		15949	
	由于房地产政策调控的放松以及郑州计划成立100亿元的房地产企业纾困基金，市场情绪有所改善。宏观面上，制造业PMI环比回落，显示板材需求仍存压力。从MySteel公布的数据看，建材产量继续上升，库存继续下降，长、短流程钢厂利润均有所改善，但钢厂复产偏谨慎，铁水产量恢复速度较慢，建材产量的上升主要是短流程钢厂复产导致。目前现货市场仍处于消费淡季，成交活跃度不高，终端需求偏淡。中长期来看，房地产期企业土地购置面积及新开工面积同比维持大幅回落态势，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，且有前期低点构成的压力，后期上涨难度较大。						
操作建议	暂时维持观望，短线只能进行高抛低吸操作，谨慎追涨						

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	775	13	1.71%	5	0.65%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	750	8	1.08%	6	0.81%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	737.5	14.5	2.01%	-49.5	-6.29%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	111.67	2.56	2.35%	-7.46	-6.26%
	普氏62%指数	美元/干吨	108	1.05	0.98%	-4.90	-4.34%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	37.5	-1.5		54.5	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	12.5	-6.5		55.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	59	1.5		-5.5	

	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	19	3.5		5.5	
品种价差	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	129	4	3.20%	4	3.20%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	121	-5	-3.97%	21	21.00%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	120	9	8.11%	27	29.03%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	135	-2	-1.46%	-8	-5.59%
	普氏65%-62%	美元/干吨	10.45	-1.05		-0.65	
	普氏62%-58%	美元/干吨	16.35	1.05		0.30	
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	7.79	-0.35	-4.30%	-2.07	-20.99%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	22.41	-1.27	-5.36%	-4.14	-15.59%
	美元指数		106.3835	-0.2035	-0.19%	0.9711	0.92%
	美元兑人民币即期		6.7508	-0.0122	-0.18%	-0.0167	-0.25%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到港量合计	万吨	1154.6	—		218.5	23.34%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	268.04	—		8.20	3.15%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	13703.98	—		169.43	1.25%
	港口贸易矿库存	万吨	7986.18	—		81.73	1.03%
	进口矿烧结粉矿总库存：64家样本钢厂	万吨	1331.01	—		6.16	0.46%
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	1700	0		100	
基本面概述	虽然近期钢厂亏损大幅改善，但钢厂复产谨慎，铁水产量并未出现非常明显的上升，钢厂补库需求并没有出现，前期多头的乐观预期存在落空的风险。目前港口库存及贸易矿的库存继续上升。最新数据显示，发运量有所回落，到港量上升。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，价格反弹之后，波动明显加大，显示市场的分歧变大，较大的基差对期价有一定支撑						
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）

2022/8/9

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	790	+12	787	+8	798	+16	810	+8	798	+16	793	+15	810	+17
卡拉加斯粉	897	+7	907	+17	930	+20	928	+8	930	+20	915	+17	925	+10
巴混63.0%	850	+12	847	+8	856	+16	875	+8	856	+16	847	+8	885	+15
巴混62.5%	830	+12	827	+8	836	+16	855	+8	836	+16	827	+8	870	+15
纽曼粉	800	+12	800	+17	810	+15	826	+8	810	+15	800	+17	838	+12
麦克粉	775	+13	773	+8	780	+15	781	+7	780	+15	775	+15	782	+12
金布巴粉60.5%	750	+8	750	+8	750	+5	757	+12	750	+5	750	+8	767	+9
金布巴粉59.5%	734	+8	734	+8	740	+5	747	+12	740	+5	734	+8	747	+9
罗伊山粉	765	+12	762	+8	763	+16	772	+8	763	+16	—	—	770	+12
IOC6	762	+12	760	+8	778	+16	795	+8	778	+16	760	+8	785	+12
FMG混合粉	717	+9	717	+9	718	+9	717	+9	718	+9	717	+9	735	+10
超特粉	651	+8	652	+10	660	+15	660	+2	660	+15	—	—	665	+10
杨迪粉	745	+6	745	+6	760	+9	742	+2	760	+9	745	6	760	+10
卡拉拉精粉	1041	+1	1041	+1	—	—	1047	+8	—	—	—	—	1025	+10
乌克兰精粉	1140	+20	—	—	1031	+20	—	—	1031	+20	1071	+1	—	—
KUMBA	905	+20	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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 744.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	45.5	42.5	53.5	65.5	53.5	48.5	65.5
卡拉加斯粉	152.5	162.5	185.5	183.5	185.5	170.5	180.5
麦克粉	30.5	28.5	35.5	36.5	35.5	30.5	37.5
金布巴粉60.5%	5.5	5.5	5.5	12.5	5.5	5.5	22.5
金布巴粉59.5%	-10.5	-10.5	-4.5	2.5	-4.5	-10.5	2.5
罗伊山粉	20.5	17.5	18.5	27.5	18.5	—	25.5
IOC6	17.5	15.5	33.5	50.5	33.5	15.5	40.5
FMG混合粉	-27.5	-27.5	-26.5	-27.5	-26.5	-27.5	-9.5
超特粉	-93.5	-92.5	-84.5	-84.5	-84.5	—	-79.5
杨迪粉	0.5	0.5	15.5	-2.5	15.5	0.5	15.5
卡拉拉精粉	296.5	296.5	—	302.5	—	—	280.5
乌克兰精粉	395.5	—	286.5	—	286.5	326.5	—
KUMBA	160.5	—	—	—	—	—	—

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

8月1日-8月7日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2611.4万吨，环比减少42.1万吨。澳洲发运量1905.8万吨，环比增加155.2万吨，其中澳洲发往中国的量1568.5万吨，环比增加37.6万吨。巴西发运量705.7万吨，环比减少197.2万吨。本期全球铁矿石发运总量3122.0万吨，环比减少111.8万吨。
(Mysteel)

工信部近日对十三届全国人大五次会议第8983号建议进行答复。关于支持钢铁与焦化企业兼并重组，工业和信息化部将答复称会同有关部门继续强化《关于促进钢铁工业高质量发展的指导意见》宣贯落实，指导和推动企业推进钢焦融合、钢化联产，促进产业耦合发展。关于加大淘汰独立焦化企业财政支持，答复称，下一步，生态环境部将持续推进钢铁和焦化行业超低排放改造，指导各地落实环境保护税优惠、差别化电价等激励政策，实施差异化环保管理。发展改革委会同有关部门制定钢铁行业碳达峰实施方案，促进钢焦产业联合发展，继续推动行业减污降碳协同增效、绿色低碳高质量发展。

【工信部：严厉打击违法违规生产销售“地条钢”行为】据工业和信息化部消息，近日，工业和信息化部对十三届全国人大五次会议第0330号建议进行答复。答复称，工业和信息化部将与发展改革委同钢铁煤炭行业化解过剩产能和脱困发展工作部际联席会议成员单位，持续巩固化解钢铁产能过剩成果，严厉打击违法违规生产销售“地条钢”行为；对使用中（工）频炉生产，但不属于“地条钢”产能或其他落后生产工艺的，支持企业依法依规实施技术改造升级，实现高质量发展。

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。