

山金期货黑色板块日报

更新时间：2022年08月11日08时15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	4066	-23	-0.56%	3	0.07%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4028	-21	-0.52%	8	0.20%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	4170	-30	-0.71%	10	0.24%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	3990	-30	-0.75%	-30	-0.75%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	104	-7		7	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-38	-9		-38	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	162	16		9	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	99	8		9	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	55	-8		5	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	69	-2		13	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-217	-8		-14	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-168	-6		-22	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	25	10		5	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	11	4		-3	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	-38	2		5		
中厚板材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	4640	-20	-0.43%	40	0.87%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4650	-30	-0.64%	-20	-0.43%
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4480	-20	-0.44%	0	0
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3730	-50	-1.32%	-30	-0.80%
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2640	100	3.94%	120	4.76%
钢厂高炉生产及盈利情况 (周度)	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%
	盈利钢厂比例	%	41.99	—		22.94	
产量 (周度)	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	245.59	—		13.22	5.69%
	热卷产量	万吨	299.96	—		-4.11	-1.35%
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	产能利用率	%	42.91	—		5.31	
	开工率	%	56.34	—		7.25	
	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	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%
	唐山地区钢坯库存	万吨	119.1	—		-0.88	-0.73%
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	12.83	-0.71	-5.23%	-2.73	-17.55%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	10800	—		600	5.88%
期货仓单	螺纹钢注册仓单数量	吨	12321	3308		5112	
	热卷注册仓单数量	吨	18609	0		17427	
基本面概述	当前建材产量继续上升, 库存继续下降, 长、短流程钢厂利润均有所改善, 但长流程钢厂复产偏谨慎, 以检修结束正常复产为主, 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。现货市场当前仍处于消费淡季, 成交活跃度不高, 终端需求偏淡, 下游追涨意愿不足。中长期来看, 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, 地产销售情况不乐观, 居民侧加杠杆意愿不足, 而基建投资所带来的需求增量相对有限, 这也决定远期需求存在较大不确定性。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, 持仓量未见明显上升, 显示后期上涨难度较大, 短期可能会回踩前期低点。						
操作建议	暂时维持观望, 待合适时机逢高中线做空, 短线只能进行高抛低吸操作						

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	762	0	0	11	1.46%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	741	2	0.27%	4	0.54%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	724.5	1.5	0.21%	-62.0	-7.88%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	109.58	-2.09	-1.87%	-5.90	-5.11%
	普氏62%指数	美元/干吨	108.4	-0.40	-0.37%	-4.90	-4.32%
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		73.0	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	16.5	0.5		66.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	63.5	4.5		-8.0	

	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	21.5	2.5		5.0	
品种价差	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	125	6	5.04%	-18	-12.59%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	116	1	0.87%	-7	-5.69%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	115	-2	-1.71%	1	0.88%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	135	-2	-1.46%	12	9.76%
	普氏65%-62%	美元/干吨	11.9	0.40		0.40	
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.05	-0.40		-0.95	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1667.2	—		105.1	6.73%
	巴西铁矿石发货量	万吨	632.2	—		-172.2	-21.41%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	8.43	0.52	6.57%	-1.45	-14.68%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	22.1	-0.05	-0.23%	-4.10	-15.65%
	美元指数		105.2395	-1.0541	-0.99%	-1.1281	-1.06%
	美元兑人民币即期		6.7245	-0.0284	-0.42%	-0.0352	-0.52%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到港量合计	万吨	1517	—		362.4	31.39%
	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	2600	0		1000	
基本面概述	虽然近期钢厂亏损面已经比前期有了大幅的改善，但长流程钢厂复产谨慎，以检修结束后正常复产为主，铁水产量并未出现非常明显的上升，长流程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，不过较大的基差或对期价有一定支撑行情维持宽幅震荡概率大，建议维持观望						
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）

2022/8/11

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	775	0	775	-3	785	+1	799	+3	785	+1	778	-1	792	+1
卡拉加斯粉	880	-5	890	-5	915	-5	917	+3	915	-5	898	-5	910	0
巴混63.0%	835	0	835	-3	843	+1	864	+3	843	+1	835	-3	866	-4
巴混62.5%	815	0	815	-3	823	+1	844	+3	823	+1	815	-3	851	-4
纽曼粉	788	0	789	+2	796	+2	815	+3	795	+1	789	+2	812	-4
麦克粉	762	0	761	+1	762	-4	769	-5	762	-3	763	-1	764	-4
金布巴粉60.5%	741	+2	742	-1	740	-3	739	-6	740	-3	740	0	748	-2
金布巴粉59.5%	725	+2	726	-1	730	-3	729	-6	730	-3	726	-1	728	-2
罗伊山粉	750	0	750	-3	750	+1	761	+3	750	+1	—	—	752	-4
IOC6	750	0	748	-3	765	+1	784	+3	765	+1	748	-3	770	-1
FMG混合粉	705	-1	706	0	705	0	703	-5	705	0	705	0	728	0
超特粉	640	0	640	-1	648	-2	646	-5	648	-2	—	—	665	0
杨迪粉	730	-3	730	-3	747	0	728	-5	747	0	730	-3	745	0
卡拉拉精粉	1029	0	1029	0	—	—	1036	+3	—	—	—	—	990	-20
乌克兰精粉	1125	-10	—	—	1016	-5	—	—	1016	-5	1059	0	—	—
KUMBA	890	-10	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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 725.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	49.5	49.5	59.5	73.5	59.5	52.5	66.5
卡拉加斯粉	154.5	164.5	189.5	191.5	189.5	172.5	184.5
麦克粉	36.5	35.5	36.5	43.5	36.5	37.5	38.5
金布巴粉60.5%	15.5	16.5	14.5	13.5	14.5	14.5	22.5
金布巴粉59.5%	-0.5	0.5	4.5	3.5	4.5	0.5	2.5
罗伊山粉	24.5	24.5	24.5	35.5	24.5	—	26.5
IOC6	24.5	22.5	39.5	58.5	39.5	22.5	44.5
FMG混合粉	-20.5	-19.5	-20.5	-22.5	-20.5	-20.5	2.5
超特粉	-85.5	-85.5	-77.5	-79.5	-77.5	—	-60.5
杨迪粉	4.5	4.5	21.5	2.5	21.5	4.5	19.5
卡拉拉精粉	303.5	303.5	—	310.5	—	—	264.5
乌克兰精粉	399.5	—	290.5	—	290.5	333.5	—
KUMBA	164.5	—	—	—	—	—	—

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

【印度政府可能会逐步取消钢铁出口关税】印度媒体Moneycontrol援引消息人士的话报道称，印度政府可能会分阶段撤销钢铁出口关税。其中，首先考虑取消的可能将是板材，钢筋等建筑钢材将维持原状。为了抑制急剧上升的通货膨胀，5月21日印度宣布对八种钢铁产品征收15%的出口税，并于5月22日生效。

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。