

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年05月09日08时51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	3732	110	3.04%	72	1.97%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3812	136	3.70%	91	2.45%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3800	50	1.33%	-30	-0.78%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3970	70	1.79%	-10	-0.25%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	68	-60		-102	
	热轧卷板主力基差	元/吨	158	-66		-101	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	70	3		8	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	71	8		-2	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	10	20		-5	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	-319	30		3	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-80	-23		-3	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	248	-38		-1	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	53	1		3	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	382	-9		-5	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	54	6		-7	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	3970	20	0.51%	-70	-1.73%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4620	0	0	-50	-1.07%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4470	0	0	-40	-0.89%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3470	0	0	-20	-0.57%
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2470	0	0	-70	-2.76%
钢厂高炉生产及盈利情况（周度）	247家钢厂高炉开工率	%	82.56	——		-2.03	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	243.54	——		-2.34	-0.95%
	盈利钢厂比例	%	22.08	——		-4.33	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	272.98	——		-10.51	-3.71%
	热卷产量	万吨	318.36	——		-2.33	-0.73%
独立电弧炉钢厂开工情况（周度）	产能利用率	%	50.42	——		-5.84	
	开工率	%	68.43	——		-6.10	
	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	1375.03	——		8.29	0.61%
	螺纹社会库存	万吨	716.01	——		-10.56	-1.45%
	热卷社会库存	万吨	264.86	——		15.79	6.34%
	五大品种钢厂库存	万吨	582.27	——		8.94	1.56%
	螺纹钢厂库存	万吨	269.47	——		1.52	0.57%
	热卷钢厂库存	万吨	92.95	——		1.60	1.75%
	唐山地区钢坯库存	万吨	89.22	——		8.92	11.11%
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	13.20	-0.54	-3.95%	-6.59	-33.28%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	9500	——		-8300	-46.63%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	143315	14974		13775	
	热卷注册仓单数量	吨	26148	0		0	
基本面概述	周一受唐山限产以及银行股大涨的影响，期价大幅上涨。整体来看，中期供应的压力并不会明显改善。目前新房市场整体销售仍乏力，同比增幅仍缓慢。另外，最新的数据显示，房屋施工面积、新开工面积均继续回落，显示下游需求仍存较大不确定因素。最新的数据显示，随着价格的下滑，产量高位持稳略有下滑，高炉铁水产量有所回落，表观需求继续缓慢下降，去库速度不及预期。铁矿石和焦炭价格的下跌驱动成本下行。从技术面看，目前价格处于下跌通道中。						
操作建议	空单持有						

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	788	9	1.16%	-15	-1.87%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	750	-5	-0.66%	-28	-3.60%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	721.5	24.0	3.44%	7.5	1.05%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	105.45	6.68	6.76%	1.54	1.48%
	普氏62%指数	美元/干吨	109.95	6.30	6.08%	3.45	3.24%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	66.5	-15.0		-22.5	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	28.5	-29.0		-35.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	46	6.0		1.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	-175.5	-11.0		17.5	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	113	2	1.80%	-1	-0.88%

品种价差	纽曼粉价差（日照港）	元/湿吨	85	0	0	-5	-5.56%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	91	0	0	4	4.60%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	140	3	2.19%	2	1.45%
	普氏65%-62%	美元/干吨	7.05	-6.30		-6.30	
	普氏62%-58%	美元/干吨	21.65	6.30		5.25	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1634.2	—		8.8	0.54%
	巴西铁矿石发货量	万吨	636.7	—		134.2	26.71%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	8.71	-0.04	-0.46%	-0.33	-3.65%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	22.32	-0.01	-0.04%	-0.27	-1.20%
	美元指数		101.2803	-0.1394	-0.14%	-0.3940	-0.39%
	美元兑人民币即期		6.908	-0.0048	-0.07%	-0.0094	-0.14%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到到货量合计	万吨	789.4	—		-195.5	-19.85%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	303.16	—		-21.00	-6.48%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	12736.28	—		-150.71	-1.17%
	港口贸易库存	万吨	7491.24	—		57.24	0.77%
	进口矿烧结粉总库存：64家样本钢厂	万吨	962.56	—		-133.64	-12.19%
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	47.87	—		-0.24	-0.50%
期货仓单	数量	张	1600	0		300	
基本面概述	受钢材价格下跌和亏损面扩大的影响，高炉铁水有所下滑，成为压制矿价的主要因素。表观需求环比回落，钢材社会库存继续下降，但去库速度不及预期。最新数据显示，发运量上升，海运费有所回落，到港量回落，库存有所上升，疏港量有所上升。钢材价格处于调整中，铁矿石较大的基差对期价有一定的支撑作用。钢厂铁矿石库存较低，对价格也有支撑。目前铁矿石供需矛盾不突出，期价大概率跟随螺纹价格走势。政策面打压以及原油价格的回调可能会对铁矿石价格形成压力						
操作建议	空单可以继续持有						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/5/9

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	797	+5	798	+6	818	+9	830	+8	817	+8	794	0	817	+7
卡拉加斯粉	884	+3	889	+6	931	+6	928	+16	920	+10	883	0	912	+7
巴混63.0%	822	+2	820	+6	842	+8	864	+8	842	+8	814	0	853	+7
巴混62.5%	817	+2	814	+6	832	+8	854	+8	832	+8	809	0	843	+7
纽曼粉	820	+1	822	+2	840	+10	842	+8	840	+10	816	0	837	+7
麦克粉	788	+9	786	+6	802	+9	810	+21	803	+13	783	0	795	0
金布巴粉60.5%	750	-5	750	-5	779	+14	773	+8	777	+12	755	0	778	+7
金布巴粉59.5%	740	-5	740	-5	769	+14	763	+8	767	+12	745	0	763	+7
罗伊山粉	786	+5	788	+6	792	+8	792	+8	792	+8	—	—	787	+7
IOC6	770	+8	761	+6	792	+8	784	+8	792	+8	740	0	797	+7
FMG混合粉	714	+1	717	+4	723	+4	725	+3	722	+2	713	0	745	+15
超特粉	655	+2	658	+3	661	+3	669	+3	660	+5	—	—	690	+15
杨迪粉	768	-1	769	-3	718	+16	732	+8	718	+16	772	0	765	+5
卡拉拉精粉	916	+5	908	+5	—	—	945	+16	—	—	—	—	897	+7
乌克兰精粉	965	0	—	—	995	+10	—	—	995	+10	925	0	—	—
KUMBA	865	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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：724.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	72.5	73.5	93.5	105.5	92.5	69.5	92.5
卡拉加斯粉	159.5	164.5	206.5	203.5	195.5	158.5	187.5
巴混63.0%	97.5	95.5	117.5	139.5	117.5	89.5	128.5
巴混62.5%	92.5	89.5	107.5	129.5	107.5	84.5	118.5
纽曼粉	95.5	97.5	115.5	117.5	115.5	91.5	112.5
麦克粉	63.5	61.5	77.5	85.5	78.5	58.5	70.5
金布巴粉60.5%	25.5	25.5	54.5	48.5	52.5	30.5	53.5
金布巴粉59.5%	15.5	15.5	44.5	38.5	42.5	20.5	38.5
罗伊山粉	61.5	63.5	67.5	67.5	67.5	—	62.5
IOC6	45.5	36.5	67.5	59.5	67.5	15.5	72.5
FMG混合粉	-10.5	-7.5	-1.5	0.5	-2.5	-11.5	20.5
超特粉	-69.5	-66.5	-63.5	-55.5	-64.5	—	-34.5
杨迪粉	43.5	44.5	-6.5	7.5	-6.5	47.5	40.5
卡拉拉精粉	191.5	183.5	—	220.5	—	—	172.5
乌克兰精粉	240.5	—	270.5	—	270.5	200.5	—
KUMBA	140.5	—	—	—	—	—	—

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

唐山市丰南区：2023年加大粗钢产量压减力度，保证全年粗钢产量不超过去年，确保完成全年粗钢压减任务。

关于市场传言“288口岸通知，日通关不超8万吨”，Mysteel与口岸部分主要进口商沟通交流获悉，绝大多数贸易企业并未从口岸官方渠道收到相关消息，个别企业对该传言尚不知晓。

据Mysteel，5月1日-5月7日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2615.4万吨，环比增加36.5万吨；中国45港铁矿石到港总量2067.3万吨，环比增加258.5万吨

作者：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。