

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年07月03日08时29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	3721	-2	-0.05%	35	0.95%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3825	10	0.26%	39	1.03%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3770	10	0.27%	-20	-0.53%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3870	10	0.26%	0	0
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	49	12		-55	
	热轧卷板主力基差	元/吨	45	0		-39	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	76	-5		-2	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	87	5		8	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	60	0		7	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	73	2		8	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-136	5		-5	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-160	-7		-16	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	93	2		-6	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	80	0		-7	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	104	12		4	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	4040	10	0.25%	-20	-0.49%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4420	0	0	0	0
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4500	0	0	30	0.67%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3540	0	0	0	0
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2500	0	0	0	0
钢厂高炉生产及盈利情况（周度）	247家钢厂 高炉开工率	%	84.09	——		1.00	
	247家钢厂 日均铁水量	万吨	245.85	——		3.29	1.36%
	盈利钢厂比例	%	64.07	——		12.12	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	276.51	——		3.24	1.19%
	热卷产量	万吨	311.06	——		2.35	0.76%
独立电弧炉钢厂开工情况（周度）	产能利用率	%	51.32	——		0.55	
	开工率	%	67.6	——		0.73	
	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	1126.42	——		17.21	1.55%
	螺纹社会库存	万吨	540.35	——		9.87	1.86%
	热卷社会库存	万吨	272.6	——		7.88	2.98%
	五大品种钢厂库存	万吨	454.34	——		19.01	4.37%
	螺纹钢厂库存	万吨	203.5	——		10.87	5.64%
	热卷钢厂库存	万吨	88.45	——		3.01	3.52%
	唐山地区钢坯库存	万吨	65.16	——		6.18	10.48%
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	21.39	-1.81	-7.81%	6.02	39.12%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	15200	——		7400	94.87%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	1496	1197		1197	
	热卷注册仓单数量	吨	131301	19886		40945	
基本面概述	目前降息已经兑现，但地产方面的政策措施尚未落地，预期仍强，市场处于强政策预期弱市场现实的状态。上涨周螺纹产量继续上涨，库存继续缓慢回落，同比已经创近几年低位，表观需求回落幅度较大，预计将在低位维持一段时间。技术面上，期价在震荡上涨，目前处于震荡收敛的状态						
操作建议	中线维持观望，短线可进行逢高做空操作，及时止盈离场。						

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	855	-7	-0.81%	21	2.52%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	817	-6	-0.73%	19	2.38%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	822.5	0	0	25.0	3.13%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	110.88	-1.92	-1.70%	0.18	0.16%
	普氏62%指数	美元/干吨	111.6	-2.35	-2.06%	-3.15	-2.75%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	32.5	-7.0		-4.0	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	-5.5	-6.0		-6.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	70.5	0		1.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	44	0		8.0	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	108	3	2.86%	2	1.89%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	94	1	1.08%	5	5.62%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	128	7	5.79%	28	28.00%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	131	-5	-3.68%	-5	-3.68%
	普氏65%-62%	美元/干吨	13.1	2.35		1.65	
	普氏62%-58%	美元/干吨	14.9	-2.35		-1.55	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1671.2	—		-218.4	-11.56%
	巴西铁矿石发货量	万吨	813.2	—		165.3	25.51%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	8.35	-0.03	-0.36%	0.40	5.03%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	20.56	-0.05	-0.24%	0.10	0.49%
	美元指数		102.9229	-0.4292	-0.42%	0.0646	0.06%
	美元兑人民币即期		7.251	0.0030	0.04%	0.0770	1.07%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1103.1	—		71.2	6.90%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	308.31	—		4.49	1.48%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	12742	—		-50.98	-0.40%
	港口贸易库存	万吨	7717.93	—		12.08	0.16%
	进口矿烧结粉总库存：64家样本钢厂	万吨	951.71	—		-23.58	-2.42%
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	48.78	—		0.57	1.18%
期货仓单	数量	张	1700	0		-200	
基本面概述	近期钢厂亏损面有所收窄，高炉铁水产量缓慢上升。钢材表观需求环比回落，钢材社会库存继续下降。最新数据显示，铁矿石发运量回落，海运费有所反弹，到港量上升，港口库存下降，疏港量有所回落。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。整体来看，铁矿石供需相对偏紧，期价大概率跟随螺纹价格走势，但较螺纹相对更强。						
操作建议	短线可进行高抛低吸，稳健者维持观望						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/7/3

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	867	-7	867	-7	895	-4	882	-6	895	-4	872	-7	898	-2
卡拉加斯粉	975	-5	995	0	1017	+8	1012	-6	1015	+5	985	0	1003	-7
巴混63.0%	892	-8	893	-7	920	+1	916	-6	920	+1	889	-7	913	-2
巴混62.5%	887	-8	887	-7	910	+1	906	-6	910	+1	883	-7	913	-2
纽曼粉	884	-6	884	-6	911	-6	900	-4	911	-1	894	-6	913	-2
麦克粉	855	-7	857	-5	871	+1	865	-3	870	-3	865	-3	875	-5
金布巴粉60.5%	817	-6	817	-7	845	+2	830	-1	845	+5	823	-3	850	-2
金布巴粉59.5%	807	-6	807	-7	835	+2	820	-1	835	+5	813	-3	835	-2
罗伊山粉	847	0	847	-2	870	-4	841	-6	870	-4	—	—	853	-2
IOC6	827	-7	827	-9	870	-9	856	-6	870	-9	817	-9	869	-2
FMG混合粉	789	-1	788	-1	795	0	790	-5	798	+3	788	0	819	-2
超特粉	735	0	736	-2	742	-4	750	-2	746	-2	—	—	764	-2
杨迪粉	794	-3	794	-3	798	+3	818	-2	798	+3	794	-3	800	-10
卡拉拉精粉	1005	0	1003	0	—	—	1019	-6	—	—	—	—	978	-7
乌克兰精粉	1025	-5	—	—	1055	+5	—	—	1055	+5	1025	0	—	—
KUMBA	930	-5	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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：827.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	39.5	39.5	67.5	54.5	67.5	44.5	70.5
卡拉加斯粉	147.5	167.5	189.5	184.5	187.5	157.5	175.5
巴混63.0%	64.5	65.5	92.5	88.5	92.5	61.5	85.5
巴混62.5%	59.5	59.5	82.5	78.5	82.5	55.5	85.5
纽曼粉	56.5	56.5	83.5	72.5	83.5	66.5	85.5
麦克粉	27.5	29.5	43.5	37.5	42.5	37.5	47.5
金布巴粉60.5%	-10.5	-10.5	17.5	2.5	17.5	-4.5	22.5
金布巴粉59.5%	-20.5	-20.5	7.5	-7.5	7.5	-14.5	7.5
罗伊山粉	19.5	19.5	42.5	13.5	42.5	—	25.5
IOC6	-0.5	-0.5	42.5	28.5	42.5	-10.5	41.5
FMG混合粉	-38.5	-39.5	-32.5	-37.5	-29.5	-39.5	-8.5
超特粉	-92.5	-91.5	-85.5	-77.5	-81.5	—	-63.5
杨迪粉	-33.5	-33.5	-29.5	-9.5	-29.5	-33.5	-27.5
卡拉拉精粉	177.5	175.5	—	191.5	—	—	150.5
乌克兰精粉	197.5	—	227.5	—	227.5	197.5	—
KUMBA	102.5	—	—	—	—	—	—

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

中国物流与采购联合会公布数据显示，6月份钢铁行业PMI为49.9%，环比上升14.7个百分点，结束连续3个月下降态势。

据Mysteel不完全统计，2023年上半年，国内有19家钢厂发布钢铁产能置换方案。其中，涉及新建炼钢产能2072.5万吨，新建炼铁产能1848.43万吨。

据Mysteel统计，若按照目前统计到的停复产计划生产，预计7月日均铁水产量244.1万吨/天。

Mysteel调研247家钢厂高炉开工率84.09%，环比上周持平，同比去年增加3.30个百分点；日均铁水产量246.88万吨，环比增加1.03万吨，同比增加10.93万吨。

中钢协最新数据显示，5月，我国钢材出口量实现环比五连升，出口保持较强韧性。另外，近期钢铁企业生产维持高位，全国钢材社会库存量有所增加。

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。