

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年07月31日08时41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	3851	-10	-0.26%	28	0.73%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4117	37	0.91%	184	4.68%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3790	-10	-0.26%	40	1.07%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	4090	20	0.49%	170	4.34%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	-61	0		12	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-27	-17		-14	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-10	-16		-66	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	53	6		-23	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	93	20		24	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	139	33		60	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-83	-4		42	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-192	-39		-37	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	203	25		113	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	157	12		77	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	266	47		156	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	4020	-10	-0.25%	60	1.52%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4490	10	0.22%	60	1.35%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4650	0	0	70	1.53%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3650	-20	-0.54%	50	1.39%
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2570	0	0	80	3.21%
钢厂高炉生产及盈利情况 （周度）	247家钢厂高炉开工率	%	83.6	——		-0.73	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	244.27	——		-0.11	-0.05%
	盈利钢厂比例	%	64.07	——		0	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	274.12	——		-4.68	-1.68%
	热卷产量	万吨	307.59	——		0.61	0.20%
独立电弧炉钢厂开工情况 （周度）	产能利用率	%	50.46	——		0.36	
	开工率	%	71.53	——		2.90	
	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	1181.6	——		13.45	1.15%
	螺纹社会库存	万吨	578.19	——		9.91	1.74%
	热卷社会库存	万吨	282.59	——		1.29	0.46%
	五大品种钢厂库存	万吨	429.57	——		-21.70	-4.81%
	螺纹钢厂库存	万吨	193.02	——		-9.26	-4.58%
	热卷钢厂库存	万吨	83.93	——		-8.38	-9.08%
	唐山地区钢坯库存	万吨	71.49	——		8.10	12.78%
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	23.09	-0.02	-0.09%	1.61	7.50%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	13600	——		-100	-0.73%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	55516	0		0	
	热卷注册仓单数量	吨	148475	0		-603	
基本面概述	政策面上，最近有钢厂收到粗钢产量平控要求，对近期钢价有一定支撑。中央召开经济工作会议后，大金融板块和黑色商品大幅上涨。上周螺纹产量回落，表观需求有所上升，库存继续上升上升，在消费淡季，库存大概率维持缓慢上升的节奏。目前房地产市场高竣工、弱销售、低开工的状况仍在继续。技术面上，期价向上突破近期震荡区间后，维持偏强的走势						
操作建议	短线逢低做多，及时止盈离场，中线暂时维持观望，不建议追涨						

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	865	-19	-2.15%	-3	-0.35%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	828	-17	-2.01%	0	0
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	834.5	0	0	-12.0	-1.42%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	111.44	-3.49	-3.04%	-2.25	-1.98%
	普氏62%指数	美元/干吨	113.1	-3.35	-2.88%	-3.15	-2.71%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	30.5	-19.0		9.0	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	-6.5	-17.0		12.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	94.5	0		20.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	23.5	0		-13.0	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	105	1	0.96%	-1	-0.94%

品种价差	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	87	0	0	-3	-3.33%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	104	-7	-6.31%	-31	-22.96%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	140	0	0	10	7.69%
	普氏65%-62%	美元/干吨	16.35	3.35		2.95	
	普氏62%-58%	美元/干吨	13	-3.35		-3.25	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1509.6	—		-72.5	-4.58%
	巴西铁矿石发货量	万吨	725.7	—		105.1	16.94%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	7.68	0.02	0.26%	0.11	1.45%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	19.51	0.16	0.83%	0.35	1.83%
	美元指数		101.7038	-0.0472	-0.05%	0.6098	0.60%
	美元兑人民币即期		7.1497	-0.0203	-0.28%	-0.0385	-0.54%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1068.9	—		-153.6	-12.56%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	313.73	—		-0.12	-0.04%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	12451.96	—		-88.60	-0.71%
	港口贸易库存	万吨	7718.76	—		-34.76	-0.45%
	进口矿烧结粉总库存：64家样本钢厂	万吨	869.51	—		3.63	0.42%
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	51.04	—		0.86	1.71%
期货仓单	数量	张	2400	0		400	
基本面概述	产量平控的要求对铁矿石价格构成一定的压力，但房地产政策面的提振对期价又有支撑。供求方面，目前发货量维持在高位，海运费整体呈下行态势，铁矿石到港量环比下降，港口库存继续下降。随着下游需求的边际转差，铁矿石的价格存一定的下行压力。						
操作建议	建议暂时维持观望，不可追涨杀跌						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/7/31

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	871	-17	872	-16	878	-12	905	-15	876	-15	878	-15	891	-17
卡拉加斯粉	972	-12	975	-17	999	-13	1014	-14	997	-13	975	-25	1015	-15
巴混63.0%	907	-17	908	-16	906	-15	945	-15	906	-15	909	-15	925	-15
巴混62.5%	901	-17	902	-16	896	-15	935	-15	896	-15	903	-15	920	-15
纽曼粉	888	-17	888	-20	900	-16	922	-15	903	-16	900	-15	908	-17
麦克粉	853	-12	855	-11	856	-14	884	-16	855	-14	858	-16	876	-17
金布巴粉60.5%	815	-13	813	-22	820	-18	846	-18	821	-17	815	-20	835	-13
金布巴粉59.5%	805	-13	803	-22	810	-18	836	-18	811	-17	805	-20	820	-13
罗伊山粉	844	-18	844	-18	851	-15	873	-15	851	-15	—	—	860	-15
IOC6	825	-14	823	-16	846	-12	849	-15	846	-12	823	-16	853	-17
FMG混合粉	770	-20	770	-20	775	-20	797	-8	777	-18	770	-22	807	-13
超特粉	737	-13	738	-10	738	-17	758	-9	738	-17	—	—	770	-13
杨迪粉	783	-19	785	-18	777	-18	813	-9	777	-18	785	-18	798	-17
卡拉拉精粉	1013	-15	1013	-15	—	—	1021	-14	—	—	—	—	1000	-15
乌克兰精粉	1045	0	—	—	1027	-13	—	—	1027	-13	1035	-15	—	—
KUMBA	950	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：829.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	41.5	42.5	48.5	75.5	46.5	48.5	61.5
卡拉加斯粉	142.5	145.5	169.5	184.5	167.5	145.5	185.5
巴混63.0%	77.5	78.5	76.5	115.5	76.5	79.5	95.5
巴混62.5%	71.5	72.5	66.5	105.5	66.5	73.5	90.5
纽曼粉	58.5	58.5	70.5	92.5	73.5	70.5	78.5
麦克粉	23.5	25.5	26.5	54.5	25.5	28.5	46.5
金布巴粉60.5%	-14.5	-16.5	-9.5	16.5	-8.5	-14.5	5.5
金布巴粉59.5%	-24.5	-26.5	-19.5	6.5	-18.5	-24.5	-9.5
罗伊山粉	14.5	14.5	21.5	43.5	21.5	—	30.5
IOC6	-4.5	-6.5	16.5	19.5	16.5	-6.5	23.5
FMG混合粉	-59.5	-59.5	-54.5	-32.5	-52.5	-59.5	-22.5
超特粉	-92.5	-91.5	-91.5	-71.5	-91.5	—	-59.5
杨迪粉	-46.5	-44.5	-52.5	-16.5	-52.5	-44.5	-31.5
卡拉拉精粉	183.5	183.5	—	191.5	—	—	170.5
乌克兰精粉	215.5	—	197.5	—	197.5	205.5	—
KUMBA	120.5	—	—	—	—	—	—

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

淡水河谷二季度净运营收入96.7亿美元，市场预期98.7亿美元；资本支出12.1亿美元，同比下降6.6%；调整后EBITDA为38.7亿美元，同比下降26%。淡水河谷卖出基础金属部门（Vale Base Metals）13%的股权，交易金额34亿美元，沙特主权财富基金PIF和沙特国有全资的沙特矿业公司（MAADEN）以25亿美元（合计）持股10%。

据Mysteel了解，云南省钢厂已陆续收到粗钢压产相关文件，通知要求：根据全省钢铁行业2023年粗钢产量调控目标任务和工作安排，对照2022年粗钢产量考核任务目标并结合钢铁企业生产经营实际，提报粗钢产量压减任务计划。

据Mysteel，7月28日河北市场钢厂对焦炭采购价上调100或110元/吨，调整后：一级湿熄焦报2210元/吨；一级干熄焦报2505元/吨；中硫湿熄焦报2010元/吨。

据钢银电商数据显示，本周城市总库存量为924.14万吨，较上周环比增加24.36万吨（+2.71%），本周建筑钢材库存总量为504.03万吨，较上周环比增加17.63万吨（+3.62%）。

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。