

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月01日08时36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	3847	-4	-0.10%	54	1.42%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4084	-33	-0.80%	166	4.24%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3790	0	0	40	1.07%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	4080	-10	-0.24%	150	3.82%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	-57	4		-14	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-4	23		-16	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-16	-6		-55	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	53	0		-8	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	106	13		38	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	143	4		71	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-90	-7		17	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-196	-4		-63	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	168	-35		65	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	131	-26		32	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	237	-29		112	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	4020	0	0	40	1.01%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4490	0	0	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	0	0	30	0.83%
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2570	0	0	30	1.18%
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	%	64.5	——		0.43	
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	%	50.57	——		0.11	
	开工率	%	72.26	——		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	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	17.91	-4.75	-20.97%	-4.76	-21.00%
	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，有钢厂收到粗钢产量平控要求，但唐山地区限产政策解除。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	856	3	0.35%	-12	-1.38%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	823	8	0.98%	-6	-0.72%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	841.5	7.0	0.84%	-1.5	-0.18%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	109.18	0.67	0.62%	-5.56	-4.85%
	普氏62%指数	美元/干吨	109.4	-3.70	-3.27%	-6.85	-5.89%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	14.5	-4.0		-10.5	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	-18.5	1.0		-4.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	88.5	-6.0		11.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	25	1.5		-10.5	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	103	-3	-2.83%	-2	-1.90%

品种价差	纽曼粉价差（日照港）	元/湿吨	88	-4	-4.35%	-3	-3.30%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	103	0	0	-26	-20.16%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	139	5	3.73%	5	3.73%
	普氏65%-62%	美元/干吨	13.3	-0.00		1.40	
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.35	-0.50		-1.80	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1625.5			115.9	7.68%
	巴西铁矿石发货量	万吨	736			10.3	1.42%
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		101.8762	0.1724	0.17%	0.4874	0.48%
	美元兑人民币即期		7.1435	-0.0062	-0.09%	-0.0425	-0.59%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到到货量合计	万吨	967.8			-101.1	-9.46%
	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	2600	0		800	
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。随着下游需求存在边际转弱的预期，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）

2023/8/1

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	877	+6	877	+5	880	+2	894	+2	880	+4	881	+3	895	+4
卡拉加斯粉	969	-3	980	+5	999	0	986	-4	1000	+3	980	+5	1020	+5
巴混63.0%	913	+6	913	+5	910	+4	934	+2	910	+4	913	+4	935	+10
巴混62.5%	907	+6	907	+5	900	+4	924	+2	900	+4	909	+6	930	+10
纽曼粉	894	+6	895	+7	906	+6	911	+2	906	+3	903	+3	912	+4
麦克粉	856	+3	856	+1	855	-1	870	0	856	+1	853	-5	886	+10
金布巴粉60.5%	823	+8	824	+11	821	+1	840	+9	820	-1	823	+8	840	+5
金布巴粉59.5%	813	+8	814	+11	811	+1	830	+9	810	-1	813	+8	825	+5
罗伊山粉	845	+1	845	+1	850	-1	862	+2	850	-1			865	+5
IOC6	835	+10	832	+9	845	-1	838	+2	845	-1	832	+9	865	+12
FMG混合粉	775	+5	775	+5	780	+5	780	0	780	+3	777	+7	817	+10
超特粉	738	+1	738	0	737	-1	741	+3	736	-2			780	+10
杨迪粉	788	+5	789	+4	780	+3	796	+3	780	+3	789	+4	805	+7
卡拉拉精粉	1016	+3	1016	+3			993	-4					1005	+5
乌克兰精粉	1030	-15			1030	+3			1030	+3	1038	+3		
KUMBA	935	-15												

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：841.0

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	36	36	39	53	39	40	54
卡拉加斯粉	128	139	158	145	159	139	179
巴混63.0%	72	72	69	93	69	72	94
巴混62.5%	66	66	59	83	59	68	89
纽曼粉	53	54	65	70	65	62	71
麦克粉	15	15	14	29	15	12	45
金布巴粉60.5%	-18	-17	-20	-1	-21	-18	-1
金布巴粉59.5%	-28	-27	-30	-11	-31	-28	-16
罗伊山粉	4	4	9	21	9		24
IOC6	-6	-9	4	-3	4	-9	24
FMG混合粉	-66	-66	-61	-61	-61	-64	-24
超特粉	-103	-103	-104	-100	-105		-61
杨迪粉	-53	-52	-61	-45	-61	-52	-36
卡拉拉精粉	175	175		152			164
乌克兰精粉	189		189		189	197	
KUMBA	94						

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

中国船协预计，2023年我国造船完工量将突破4200万载重吨，新船订单量超过5000万载重吨，手持船舶订单保持约1.2亿载重吨。

据SMM，7月31日唐山市环保限产解除，7月下旬因环保加严停产的高炉和烧结机均计划复产，预计铁水增量3.14万吨/日。

从中物联钢铁物流专业委员会调查、发布的钢铁行业PMI来看，2023年7月份为49.9%，与上月持平，显示钢铁市场保持平稳运行。预计8月份，市场需求有所扩张，生产端稳中有增但上升空间有限，原材料价格偏强运行，钢材价格震荡上行。

据Mysteel，7月24日-7月30日中国47港铁矿石到港总量2090.3万吨，环比减少390.4万吨；中国45港铁矿石到港总量2033.8万吨，环比减少295.5万吨；北方六港铁矿石到港总量为967.8万吨，环比减少101.1万吨。

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。