

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月04日08时38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	3728	-73	-1.92%	-133	-3.44%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3984	-46	-1.14%	-96	-2.35%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	3720	-60	-1.59%	-80	-2.11%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	3980	-50	-1.24%	-90	-2.21%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	-8	13		53	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-4	-4		6	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-9	-3		-15	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	51	-8		4	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	85	-12		12	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	136	10		30	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-76	15		3	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-187	-2		-34	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	196	32		18	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	145	10		0	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	256	27		37		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	3980	-50	-1.24%	-50	-1.24%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4480	-10	-0.22%	0	0
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4680	0	0	30	0.65%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3580	-40	-1.10%	-90	-2.45%
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2570	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	%	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	269.78	—		-4.34	-1.58%
	热卷产量	万吨	305.26	—		-2.33	-0.76%
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	1206.83	—		25.23	2.14%
	螺纹钢社会库存	万吨	597.58	—		19.39	3.35%
	热卷社会库存	万吨	286.73	—		4.14	1.47%
	五大品种钢厂库存	万吨	437.39	—		7.82	1.82%
	螺纹钢厂库存	万吨	196.77	—		3.75	1.94%
	热卷钢厂库存	万吨	83.5	—		-0.43	-0.51%
	唐山地区钢坯库存	万吨	71.62	—		0.13	0.18%
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	15.81	-4.17	-20.87%	-7.46	-32.06%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	13600	—		0	0
期货仓单	螺纹钢注册仓单数量	吨	55516	0		0	
	热卷注册仓单数量	吨	148780	0		305	
基本面概述	期价调整主要因利多已经反映在价格中。政策面上, 粗钢产量平控对产量影响小。中央召开经济工作会议后, 市场对房地产信心增强, 但也反映在几个中, 房地产高竣工、弱销售、低开工的状况没有明显改善。上周螺纹产量回落, 表观需求大幅下降, 库存继续上升, 在消费淡季, 库存大概率维持缓慢上升的节奏。技术面上, 期价大幅回调, 对中线上行趋势已经形成破坏。						
操作建议	中线空单可逢高入场						

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	825	-23	-2.71%	-40	-4.62%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	791	-29	-3.54%	-37	-4.47%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	810.5	-20.5	-2.47%	-38.0	-4.48%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	100.73	-3.17	-3.05%	-14.08	-12.26%
	普氏62%指数	美元/干吨	103.75	-3.20	-2.99%	-9.35	-8.27%
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	-2.5		-2.0	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-19.5	-8.5		1.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	88.5	3.0		-1.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	21.5	-2.5		-13.0	
	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	90	-9	-9.09%	-15	-14.29%

品种价差	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	75	-10	-11.76%	-12	-13.79%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	101	-3	-2.88%	-19	-15.83%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	135	-4	-2.88%	-5	-3.57%
	普氏65%-62%	美元/干吨	16.5		3.20		3.20
	普氏62%-58%	美元/干吨	12.65		-3.20		-3.20
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	8.15	-0.06	-0.73%	0.55	7.24%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	20.09	0.06	0.30%	0.97	5.07%
	美元指数		102.4776	-0.1640	-0.16%	0.7266	0.71%
	美元兑人民币即期		7.1716	-0.0204	-0.28%	0.0016	0.02%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	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%
	港口贸易矿库存	万吨	7718.76			-34.76	-0.45%
	进口矿烧结粉矿总库存：64家样本钢厂	万吨	863.81			-5.70	-0.66%
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	3000			0	600
基本概述	产量平控的要求对铁矿石价格构成一定的压力，房地产政策面的利多转为下游需求的好转还需要时间。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	可轻仓做空						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/8/4

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	840	-26	840	-26	841	-26	868	-17	841	-27	849	-26	856	-29
卡拉加斯粉	938	-22	941	-29	973	-20	955	-29	975	-19	941	-29	980	-30
巴混63.0%	876	-26	876	-26	871	-27	908	-17	871	-27	881	-26	895	-30
巴混62.5%	870	-26	870	-26	861	-27	898	-17	861	-27	877	-26	890	-30
纽曼粉	858	-26	858	-25	865	-26	885	-17	868	-22	871	-26	871	-31
麦克粉	825	-23	824	-22	833	-16	840	-25	833	-19	836	-15	850	-25
金布巴粉60.5%	791	-29	791	-26	794	-25	800	-24	795	-23	797	-21	815	-25
金布巴粉59.5%	781	-29	781	-26	784	-25	790	-24	785	-23	787	-21	800	-25
罗伊山粉	815	-27	815	-27	811	-27	836	-17	811	-27			830	-25
IOC6	801	-23	797	-26	806	-27	812	-17	806	-27	797	-26	826	-29
FMG混合粉	748	-20	754	-15	767	-20	770	-18	767	-16	755	-20	783	-22
超特粉	707	-21	705	-22	720	-15	727	-18	718	-17			753	-22
杨迪粉	761	-24	760	-26	767	-16	782	-18	767	-16	760	-26	766	-24
卡拉拉精粉	991	-15	991	-15			962	-29					965	-30
乌克兰精粉	1015	-15			1005	-19			1005	-19	1013	-15		
KUMBA	920	-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：821.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	18.5	18.5	19.5	46.5	19.5	27.5	34.5
卡拉加斯粉	116.5	119.5	151.5	133.5	153.5	119.5	158.5
巴混63.0%	54.5	54.5	49.5	86.5	49.5	59.5	73.5
巴混62.5%	48.5	48.5	39.5	76.5	39.5	55.5	68.5
纽曼粉	36.5	36.5	43.5	63.5	46.5	49.5	49.5
麦克粉	3.5	2.5	11.5	18.5	11.5	14.5	28.5
金布巴粉60.5%	-30.5	-30.5	-27.5	-21.5	-26.5	-24.5	-6.5
金布巴粉59.5%	-40.5	-40.5	-37.5	-31.5	-36.5	-34.5	-21.5
罗伊山粉	-6.5	-6.5	-10.5	14.5	-10.5		8.5
IOC6	-20.5	-24.5	-15.5	-9.5	-15.5	-24.5	4.5
FMG混合粉	-73.5	-67.5	-54.5	-51.5	-54.5	-66.5	-38.5
超特粉	-114.5	-116.5	-101.5	-94.5	-103.5		-68.5
杨迪粉	-60.5	-61.5	-54.5	-39.5	-54.5	-61.5	-55.5
卡拉拉精粉	169.5	169.5		140.5			143.5
乌克兰精粉	193.5		183.5		183.5	191.5	
KUMBA	98.5						

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

据中钢协估算，7月下旬，全国日产粗钢293.32万吨，环比下降3.49%；日产生铁247.28万吨，下降3.29%；日产钢材405.31万吨，下降0.21%。

据隆众资讯，本周全国浮法玻璃平均产销率前低后高，现货市场拿货情绪周内逐渐好转，行业维持去库状态。截止到8月3日，全国浮法玻璃样本企业总库存4571.4万重箱，处于近3个月低位，环比下滑75.1万重箱或1.62%，同比下降42.46%。

据Mysteel，截至8月3日当周，产量连续两周下降，厂库由降转增，社库连续第六周增加，表需由增转降。其中，螺纹产量269.78万吨，较上周减少4.34万吨，降幅为1.58%；螺纹厂库196.77万吨，较上周增加3.75万吨，增幅为1.94%。

本周Mysteel煤焦事业部调研全国30家独立焦化厂吨焦盈利情况，全国平均吨焦盈利51元/吨；山西准一级焦平均盈利39元/吨，山东准一级焦平均盈利83元/吨，内蒙二级焦平均盈利58元/吨，河北准一级焦平均盈利63元/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。