

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月08日08时43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	-4	-0.11%	-115	-2.99%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3984	-6	-0.15%	-100	-2.45%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	3710	-10	-0.27%	-80	-2.11%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	3980	-10	-0.25%	-100	-2.45%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	-22	-6		35	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-4	-4		0	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-11	2		5	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	44	-5		-9	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	96	1		-10	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	142	10		-1	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-85	-3		5	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-186	-5		10	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	197	5		29	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	151	-4		20	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	252	-2		15		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	3940	-10	-0.25%	-80	-1.99%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4480	0	0	-10	-0.22%
	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	3560	-20	-0.56%	-90	-2.47%
	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	%	82.14	——		-1.46	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	240.69	——		-3.58	-1.47%
	盈利钢厂比例	%	64.94	——		0.44	
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	%	50.82	——		0.25	
	开工率	%	72.26	——		0	
	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	16.44	-4.56	-21.69%	-6.02	-26.81%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	12100	——		-1500	-11.03%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	56728	1212		1212	
	热卷注册仓单数量	吨	153988	3671		5513	
基本面概述	政策面上, 粗钢产量平控对当前产量影响小, 房地产政策调整对需求的影响存在时滞, 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	中线空单可轻仓持有, 待反抽后可加仓						

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	820	-9	-1.09%	-36	-4.21%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	785	-13	-1.63%	-38	-4.62%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	719.5	-98.0	-11.99%	-122.0	-14.50%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	101.04	-0.67	-0.66%	-10.40	-9.33%
	普氏62%指数	美元/干吨	104.1	-0.95	-0.90%	-5.95	-5.41%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	100.5	89.0		86.0	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	65.5	85.0		84.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	95	3.0		6.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	21.5	-0.5		-3.5	
PB块粉价差 (日照港)	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	97	12	14.12%	-6	-5.83%
	纽曼块粉价差 (日照港)	元/湿吨	82	10	13.89%	-6	-6.82%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	105	5	5.00%	1	0.96%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	136	-8	-5.56%	-4	-2.86%
	普氏65%-62%	美元/干吨	13.15	0.95		-0.15	
	普氏62%-58%	美元/干吨	14.2	-0.95		-1.70	
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	8.24	0.19	2.36%	0.56	7.29%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	20.02	0.05	0.25%	0.51	2.61%
	美元指数		101.9986	-0.4790	-0.47%	0.2948	0.29%
	美元兑人民币即期		7.174	0.0024	0.03%	0.0243	0.34%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	951.1	—		-16.7	-1.73%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	300.75	—		-12.98	-4.14%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	12290.36	—		-161.60	-1.30%
	港口贸易矿库存	万吨	7569.52	—		-149.24	-1.93%
	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	2700	0		0	
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，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	空单可轻仓持有						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/8/8

	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	-10	840	-10	838	-7	861	-6	840	-5	850	-5	860	-5
卡拉加斯粉	938	-4	945	-5	964	-7	954	-9	965	-3	945	-5	975	-14
巴混63.0%	876	-10	876	-10	870	-5	901	-6	870	-5	882	-5	890	-14
巴混62.5%	870	-10	870	-10	860	-5	891	-6	860	-5	878	-5	885	-14
纽曼粉	859	-7	858	-8	859	-7	878	-6	859	-6	858	-19	875	-5
麦克粉	820	-9	820	-9	820	-13	840	-7	822	-8	823	-16	845	-10
金布巴粉60.5%	785	-13	785	-11	795	-3	805	-4	797	-3	788	-15	810	-5
金布巴粉59.5%	775	-13	775	-11	785	-3	795	-4	787	-3	778	-15	795	-5
罗伊山粉	816	-9	816	-9	810	-5	829	-6	810	-5	—	—	830	-5
IOC6	799	-9	797	-10	805	-5	795	-16	805	-5	797	-10	825	-10
FMG混合粉	757	-11	756	-12	765	-13	765	-13	761	-9	757	-11	788	-10
超特粉	704	-3	704	-2	715	-2	722	-13	713	-2	—	—	750	-13
杨迪粉	766	-3	762	-6	761	-9	777	-13	761	-9	762	-6	770	-5
卡拉拉精粉	988	-8	988	-8	—	—	961	-9	—	—	—	—	960	-14
乌克兰精粉	1000	-15	—	—	995	-3	—	—	995	-3	1010	-8	—	—
KUMBA	905	-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：725.0

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	115	115	113	136	115	125	135
卡拉加斯粉	213	220	239	229	240	220	250
巴混63.0%	151	151	145	176	145	157	165
巴混62.5%	145	145	135	166	135	153	160
纽曼粉	134	133	134	153	134	133	150
麦克粉	95	95	95	115	97	98	120
金布巴粉60.5%	60	60	70	80	72	63	85
金布巴粉59.5%	50	50	60	70	62	53	70
罗伊山粉	91	91	85	104	85	—	105
IOC6	74	72	80	70	80	72	100
FMG混合粉	32	31	40	40	36	32	63
超特粉	-21	-21	-10	-3	-12	—	25
杨迪粉	41	37	36	52	36	37	45
卡拉拉精粉	263	263	—	236	—	—	235
乌克兰精粉	275	—	270	—	270	285	—
KUMBA	180	—	—	—	—	—	—

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

根据目前煤焦钢市场现状，自8月8日零时起，山东省内潍坊、滨州、德州、济宁、枣庄、菏泽、日照、泰安、临沂等各地焦炭生产企业焦炭价格在原价格基础上湿熄焦上调100元/吨、干熄焦上调110元/吨。

7月31日—8月6日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2280.7万吨，环比减少385.0万吨。澳洲发运量1688.1万吨，环比减少166.5万吨，其中澳洲发往中国的量1335.9万吨，环比减少112.7万吨。巴西发运量592.7万吨，环比减少218.5万吨。

据Mysteel，8月河钢硅铁招标定价7330元/吨，较上月上涨80元/吨，7月定价7250元/吨，8月招标数量2600吨，7月招标数量2640吨，较7月减少40吨。

7月31日-8月6日中国47港铁矿石到港总量1935.3万吨，环比减少155.0万吨；中国45港铁矿石到港总量1867.4万吨，环比减少166.5万吨；北方六港铁矿石到港总量为951.1万吨，环比减少16.7万吨。

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。