

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月11日08时37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	3671	-29	-0.78%	-57	-1.53%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3921	-43	-1.08%	-63	-1.58%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3700	0	0	-20	-0.54%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3920	-40	-1.01%	-60	-1.51%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	29	29		37	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-1	3		3	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-30	-16		-21	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	42	-5		-9	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	73	-5		-12	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	123	-6		-13	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-43	21		33	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-165	11		22	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	178	-25		-18	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	128	-24		-17	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	250	-14		-6	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	3930	10	0.26%	-50	-1.26%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4470	-10	-0.22%	-10	-0.22%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4680	0	0	0	0
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3520	-20	-0.56%	-60	-1.68%
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2550	0	0	-20	-0.78%
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	265.67	——		-4.11	-1.52%
	热卷产量	万吨	311.71	——		6.45	2.11%
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	1220.89	——		14.06	1.17%
	螺纹社会库存	万吨	610.67	——		13.09	2.19%
	热卷社会库存	万吨	288.11	——		1.38	0.48%
	五大品种钢厂库存	万吨	454.72	——		17.33	3.96%
	螺纹钢厂库存	万吨	205.26	——		8.49	4.31%
	热卷钢厂库存	万吨	85.81	——		2.31	2.77%
	唐山地区钢坯库存	万吨	64.26	——		-7.36	-10.28%
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	17.34	-4.06	-18.96%	-2.52	-12.70%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	12100	——		0	0
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	65813	1531		10297	
	热卷注册仓单数量	吨	200226	16394		51446	
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，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	810	-7	-0.86%	-15	-1.82%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	789	8	1.02%	-2	-0.25%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	714.5	-8.5	-1.18%	-96.0	-11.84%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	100.73	-0.71	-0.70%	-5.30	-5.00%
	普氏62%指数	美元/干吨	104.8	-0.25	-0.24%	-4.75	-4.34%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	95.5	1.5		81.0	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	74.5	16.5		94.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	98	1.5		9.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	20.5	-1.0		-1.0	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	100	4	4.17%	10	11.11%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	84	1	1.20%	9	12.00%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	103	2	1.98%	-1	-0.96%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	132	-2	-1.49%	-9	-6.38%
	普氏65%-62%	美元/干吨	12	0.75		-1.30	
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.25	-0.60		-0.85	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1484.9	——		-140.6	-8.65%
	巴西铁矿石发货量	万吨	530.8	——		-205.2	-27.88%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	8.34	-0.20	-2.34%	0.19	2.33%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	20.45	-0.05	-0.24%	0.36	1.79%
	美元指数		102.6066	0.1203	0.12%	0.1290	0.13%
	美元兑人民币即期		7.2177	0.0061	0.08%	0.0461	0.64%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到到货量合计	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%
	港口贸易库存	万吨	7569.52	——		-149.24	-1.93%
	进口矿烧结粉总库存：64家样本钢厂	万吨	887.89	——		24.08	2.79%
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	2200	0		-600	
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，目前发货量大幅回落，海运费有所反弹，铁矿石到港量环比下降，港口库存继续下降，下游需求存在边际好转的预期。整体来看，随着螺纹的下跌吗，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）

2023/8/11

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	831	-8	830	-9	833	-7	857	-8	834	-8	845	-5	853	-5
卡拉加斯粉	934	-6	933	-7	950	-15	954	-6	954	-14	933	-7	970	0
巴混63.0%	867	-8	866	-9	864	-8	897	-8	864	-8	877	-5	890	-5
巴混62.5%	861	-8	860	-9	854	-8	887	-8	854	-8	873	-5	885	-5
纽曼粉	849	-4	849	-6	847	-12	874	-8	847	-12	855	-3	870	-3
麦克粉	810	-7	810	-10	816	-9	838	-5	819	-6	818	-6	840	-5
金布巴粉60.5%	789	+8	788	+3	790	-3	800	-5	791	+1	790	0	800	0
金布巴粉59.5%	779	+8	778	+3	780	-3	790	-5	781	+1	780	0	785	0
罗伊山粉	801	-8	800	-9	814	-8	825	-8	814	-8	——	——	828	-5
IOC6	785	-3	798	0	799	-8	783	-12	799	-8	798	0	825	-10
FMG混合粉	758	-2	758	-3	764	-1	765	0	762	-1	757	-3	783	-5
超特粉	699	-6	698	-7	700	-10	716	0	700	-10	——	——	740	-5
杨迪粉	780	-3	785	-3	762	-1	771	0	762	-1	785	-3	758	-10
卡拉拉精粉	983	0	983	0	——	——	961	-6	——	——	——	——	955	0
乌克兰精粉	1005	+5	——	——	984	-14	——	——	984	-14	1005	0	——	——
KUMBA	910	+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： 728.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	102.5	101.5	104.5	128.5	105.5	116.5	124.5
卡拉加斯粉	205.5	204.5	221.5	225.5	225.5	204.5	241.5
巴混63.0%	138.5	137.5	135.5	168.5	135.5	148.5	161.5
巴混62.5%	132.5	131.5	125.5	158.5	125.5	144.5	156.5
纽曼粉	120.5	120.5	118.5	145.5	118.5	126.5	141.5
麦克粉	81.5	81.5	87.5	109.5	90.5	89.5	111.5
金布巴粉60.5%	60.5	59.5	61.5	71.5	62.5	61.5	71.5
金布巴粉59.5%	50.5	49.5	51.5	61.5	52.5	51.5	56.5
罗伊山粉	72.5	71.5	85.5	96.5	85.5	——	99.5
IOC6	56.5	69.5	70.5	54.5	70.5	69.5	96.5
FMG混合粉	29.5	29.5	35.5	36.5	33.5	28.5	54.5
超特粉	-29.5	-30.5	-28.5	-12.5	-28.5	——	11.5
杨迪粉	51.5	56.5	33.5	42.5	33.5	56.5	29.5
卡拉拉精粉	254.5	254.5	——	232.5	——	——	226.5
乌克兰精粉	276.5	——	255.5	——	255.5	276.5	——
KUMBA	181.5	——	——	——	——	——	——

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

7月国内煤焦钢产业链整体偏强运行。其中，原料煤持续涨价，焦企利润空间不足，部分焦企出现减产行为，短期供应收紧；铁水仍在相对高位，叠加钢厂焦炭库存低位，焦炭需求偏强，带动7月焦炭落实三轮涨价，累计涨幅200元/吨。

截止到8月10日，全国浮法玻璃样本企业总库存4163.4万重箱，连降5周创逾1年新低，环比下滑408万重箱或8.93%，同比减少41.3%，折库存天数较上期下降1.7天至18.1天。

新疆生态环境厅网站近日发布了《新疆维吾尔自治区关于〈自治区减污降碳协同增效实施方案〉的通知》。《方案》提到，大气污染防治重点区域严禁新增钢铁、水泥、塑料、平板玻璃、煤化工产能，严控新增炼油产能。其他地区钢铁、水泥、塑料、平板玻璃、炼油、电解铝等新建、扩建项目严格实施产能等量或减量置换要求。

据Mysteel，截至8月10日当周，产量连续三周下降，厂库连续两周增加，社库连续七周增加，表需连续两周下降。螺纹产量265.67万吨，较上周减少4.11万吨，降幅为1.53%；螺纹钢周需244.00万吨，较上周减少2.55万吨，降幅为1.03%。

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。