

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月21日08时51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	3700	-26	-0.70%	9	0.24%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3905	-19	-0.48%	-32	-0.81%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3730	0	0	30	0.81%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3900	-10	-0.26%	-30	-0.76%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	30	26		21	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-5	9		2	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-18	1		18	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	47	3		-2	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	74	-11		5	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	105	-17		-11	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-56	10		-23	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-152	14		13	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	140	5		-21	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	109	11		-5	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	205	7		-41	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	3960	0	0	30	0.76%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4450	0	0	-10	-0.22%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4720	20	0.43%	40	0.85%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3530	0	0	10	0.28%
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2550	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	%	83.36	——		1.22	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	240.98	——		0.29	0.12%
	盈利钢厂比例	%	61.47	——		-3.47	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	263.80	——		-1.87	-0.70%
	热卷产量	万吨	314.66	——		2.95	0.95%
独立电弧炉钢厂开工情况 （周度）	产能利用率	%	54.7	——		2.12	
	开工率	%	74.64	——		0.52	
	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	1210.53	——		-10.36	-0.85%
	螺纹社会库存	万吨	602.12	——		-8.55	-1.40%
	热卷社会库存	万吨	289.32	——		1.21	0.42%
	五大品种钢厂库存	万吨	449.8	——		-4.92	-1.08%
	螺纹钢厂库存	万吨	204.28	——		-0.98	-0.48%
	热卷钢厂库存	万吨	85.4	——		-0.41	-0.48%
	唐山地区钢坯库存	万吨	59.97	——		-4.29	-6.68%
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	17.33	-4.18	-19.43%	-4.19	-19.46%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	13300	——		0	0
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	101826	17863		36013	
	热卷注册仓单数量	吨	237725	-596		-596	
基本面概述	虽然近期央行同步下调7天期逆回购、常备借贷便利以及MLF利率，超出市场预期，提振了市场情绪，但产业层面的利空正在逐渐累积。各地粗钢产量平控政策陆续明确，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。市场逐渐进入旺季，上周螺纹产量回落，预计未来将逐步回升，表观需求有所上升，库存继续开始下降。						
操作建议	中线空单可加仓						

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	815	5	0.62%	-2	-0.24%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	795	3	0.38%	12	1.53%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	771.5	0	0	32.5	4.40%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	105.65	4.84	4.80%	5.36	5.34%
	普氏62%指数	美元/干吨	103.45	-1.65	-1.57%	-1.60	-1.52%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	43.5	5.0		-34.5	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	23.5	3.0		-20.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	91	0		0.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	34.5	0		12.5	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	101	-2	-1.94%	6	6.32%

品种价差	纽曼粉价差（日照港）	元/湿吨	78	-8	-9.30%	-5	-6.02%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	101	-2	-1.94%	1	1.00%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	128	0	0	-16	-11.11%
	普氏65%-62%	美元/干吨	11.8	-0.20		-0.40	
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.2	-0.30		0.05	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1732.7	——		247.8	16.69%
	巴西铁矿石发货量	万吨	804.9	——		274.1	51.64%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	7.94	0.27	3.52%	-0.40	-4.80%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	21.18	1.01	5.01%	0.73	3.57%
	美元指数		103.4502	0.0279	0.03%	0.8436	0.82%
	美元兑人民币即期		7.2888	-0.0102	-0.14%	0.0711	0.99%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1696.6	——		745.5	78.38%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	316.85	——		16.10	5.35%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	11945.91	——		-344.45	-2.80%
	港口贸易库存	万吨	7436.72	——		-132.80	-1.75%
	进口矿烧结粉矿总库存：64家样本钢厂	万吨	869	——		-18.89	-2.13%
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	50.57	——		-0.47	-0.92%
期货仓单	数量	张	2200	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，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，目前发货量大幅上升，海运费有所反弹，铁矿石到港量环比大幅上升，疏港量回升，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，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，短线有反弹需求						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/8/21

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	863	+6	862	+6	867	+5	865	+20	866	+4	866	+20	880	+16
卡拉加斯粉	950	0	953	0	950	-1	954	+15	946	-7	953	+19	990	+15
巴混63.0%	893	+6	892	+6	896	+4	905	+20	896	+4	882	+20	921	+16
巴混62.5%	888	+6	887	+6	886	+4	895	+20	886	+4	877	+20	916	+16
纽曼粉	874	+3	875	+4	871	+6	880	+20	871	+4	876	+20	895	+16
麦克粉	844	+6	842	+7	850	+7	850	+10	850	+7	845	+21	870	+20
金布巴粉60.5%	812	+4	813	+5	815	-2	820	+18	818	-2	825	+26	825	+16
金布巴粉59.5%	802	+4	803	+5	805	-2	810	+18	808	-2	815	+26	810	+16
罗伊山粉	833	+6	832	+6	846	+4	833	+20	846	+4	—	—	855	+16
IOC6	825	+1	826	+2	831	+4	815	+20	831	+4	824	+22	845	+21
FMG混合粉	774	+1	771	-2	780	+5	780	+13	780	+5	774	+11	798	+10
超特粉	720	0	719	-1	722	+5	725	+5	722	+6	—	—	755	+10
杨迪粉	798	0	800	+1	770	+5	780	+5	770	+5	799	+13	794	+19
卡拉拉精粉	988	0	988	0	—	—	961	+15	—	—	—	—	975	+15
乌克兰精粉	1030	0	—	—	976	-7	—	—	976	-7	1010	+10	—	—
KUMBA	935	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：761.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	101.5	100.5	105.5	103.5	104.5	104.5	118.5
卡拉加斯粉	188.5	191.5	188.5	192.5	184.5	191.5	228.5
巴混63.0%	131.5	130.5	134.5	143.5	134.5	120.5	159.5
巴混62.5%	126.5	125.5	124.5	133.5	124.5	115.5	154.5
纽曼粉	112.5	113.5	109.5	118.5	109.5	114.5	133.5
麦克粉	82.5	80.5	88.5	88.5	88.5	83.5	108.5
金布巴粉60.5%	50.5	51.5	53.5	58.5	56.5	63.5	63.5
金布巴粉59.5%	40.5	41.5	43.5	48.5	46.5	53.5	48.5
罗伊山粉	71.5	70.5	84.5	71.5	84.5	—	93.5
IOC6	63.5	64.5	69.5	53.5	69.5	62.5	83.5
FMG混合粉	12.5	9.5	18.5	18.5	18.5	12.5	36.5
超特粉	-41.5	-42.5	-39.5	-36.5	-39.5	—	-6.5
杨迪粉	36.5	38.5	8.5	18.5	8.5	37.5	32.5
卡拉拉精粉	226.5	226.5	—	199.5	—	—	213.5
乌克兰精粉	268.5	—	214.5	—	214.5	248.5	—
KUMBA	173.5	—	—	—	—	—	—

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

据焦联网，山东、河北、唐山、天津、山西区域等钢厂对焦炭采购价格进行第一轮提降 100-110元/吨。

据钢银电商，截至8月21日当周，全国钢市总库存量为955.30万吨，较上周环比减少10.15万吨（-1.05%）。其中，建筑钢材库存总量为521.68万吨，较上周环比减少14.29万吨（-2.67%）。

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。