

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月24日08时35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	3723	0	0	10	0.27%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3937	20	0.51%	11	0.28%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	3740	20	0.54%	10	0.27%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	3920	20	0.51%	10	0.26%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	17	20		0	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-17	0		-1	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-24	-14		-10	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	62	1		18	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	63	-3		-26	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	93	2		-29	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-39	17		36	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-155	-3		11	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	128	5		-27	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	98	0		-24	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	214	20		1		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	3950	20	0.51%	10	0.25%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4420	10	0.23%	-40	-0.90%
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4750	10	0.21%	50	1.06%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3550	20	0.57%	30	0.85%
	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	%	83.8	——		0.44	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	243.6	——		2.62	1.09%
	盈利钢厂比例	%	58.87	——		-2.60	
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	22.69	0.66	3.01%	1.28	5.98%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	15100	——		1800	13.53%
期货仓单	螺纹钢注册仓单数量	吨	123126	4496		43082	
	热卷注册仓单数量	吨	225765	-1797		-12556	
基本面概述	中央允许地方政府发行1.5万亿特别融资债券, 短线极大的提振了市场的风险偏好。产业方面, 各地粗钢产量平控政策陆续明确, 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, 市场逐渐进入旺季, 但成色明显不足。目前市场是弱现实和弱宏观与强政策的博弈, 短线多头略占优势						
操作建议	空单轻仓持有, 如果向上有效突破近期震荡区间, 空单需要及时止损离场。						

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	879	1	0.11%	62	7.59%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	848	3	0.36%	54	6.80%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	817	11.5	1.43%	78.5	10.63%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	113.25	2.57	2.32%	12.81	12.75%
	普氏62%指数	美元/干吨	116.5	3.20	2.82%	12.05	11.54%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	62	-10.5		-16.5	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	31	-8.5		-24.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	86.5	-8.5		-1.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	45.5	-7.0		18.0	
PB块粉价差 (日照港)	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	94	-6	-6.00%	-7	-6.93%
	纽曼块粉价差 (日照港)	元/湿吨	79	-8	-9.20%	1	1.28%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	78	4	5.41%	-25	-24.27%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	154	-3	-1.91%	26	20.31%
	普氏65%-62%	美元/干吨	8.65	-3.20		-3.35	
	普氏62%-58%	美元/干吨	18.9	3.20		2.95	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1626	—		-106.7	-6.16%
	巴西铁矿石发货量	万吨	725.2	—		-79.7	-9.90%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	7.76	-0.01	-0.13%	0.09	1.17%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	20.71	-0.39	-1.85%	0.54	2.68%
	美元指数		103.6071	0.2898	0.28%	0.3994	0.39%
	美元兑人民币即期		7.294	0.0124	0.17%	0.0041	0.06%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1043.8	—		-652.8	-38.48%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	326.72	—		9.87	3.12%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	12050.99	—		105.08	0.88%
	港口贸易矿库存	万吨	7480.48	—		43.76	0.59%
	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，目前发货量环比小幅回落，海运费有所反弹，铁矿石到港量环比大幅上升，疏港量回升，港口库存有所上升，下游需求存在边际好转的预期。整体来看，随着螺纹的上涨以及铁水产量的回升，铁矿石的价格有望维持偏强的走势						
操作建议	维持观望，谨慎追涨						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/8/24

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	903	+1	903	+2	900	+1	900	0	900	0	907	+6	919	+5
卡拉加斯粉	978	+2	981	+6	996	+21	992	+12	996	+20	981	+6	1020	0
巴混63.0%	933	+1	933	+2	930	0	940	0	930	0	927	+6	954	+5
巴混62.5%	928	+1	928	+2	920	0	930	0	920	0	922	+6	949	+5
纽曼粉	915	+2	917	+1	906	+1	915	0	906	0	917	+6	934	+5
麦克粉	879	+1	874	-4	885	+9	884	+6	883	+6	885	+7	900	+12
金布巴粉60.5%	848	+3	849	+3	850	+2	851	+1	850	+2	848	0	864	+5
金布巴粉59.5%	838	+3	839	+3	840	+2	841	+1	840	+2	838	0	849	+5
罗伊山粉	873	+1	873	+2	880	0	868	0	880	0	—	—	894	+5
IOC6	863	+1	865	+5	865	0	875	+13	865	0	865	+5	884	+5
FMG混合粉	808	+9	808	+9	813	+14	819	+19	808	+9	808	+9	824	+6
超特粉	749	+5	749	+5	755	+10	768	+8	754	+9	—	—	781	+6
杨迪粉	836	+5	842	+9	798	+9	823	+8	798	+9	818	+9	825	0
卡拉拉精粉	1003	0	1003	0	—	—	999	+12	—	—	—	—	1005	0
乌克兰精粉	1055	+5	—	—	1026	+20	—	—	1026	+20	1025	0	—	—
KUMBA	960	+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：827.0

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	76	76	73	73	73	80	92
卡拉加斯粉	151	154	169	165	169	154	193
巴混63.0%	106	106	103	113	103	100	127
巴混62.5%	101	101	93	103	93	95	122
纽曼粉	88	90	79	88	79	90	107
麦克粉	52	47	58	57	56	58	73
金布巴粉60.5%	21	22	23	24	23	21	37
金布巴粉59.5%	11	12	13	14	13	11	22
罗伊山粉	46	46	53	41	53	—	67
IOC6	36	38	38	48	38	38	57
FMG混合粉	-19	-19	-14	-8	-19	-19	-3
超特粉	-78	-78	-72	-59	-73	—	-46
杨迪粉	9	15	-29	-4	-29	-9	-2
卡拉拉精粉	176	176	—	172	—	—	178
乌克兰精粉	228	—	199	—	199	198	—
KUMBA	133	—	—	—	—	—	—

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

世界钢铁协会公布数据显示，7月份，全球63个纳入世界钢铁协会统计国家粗钢产量为1.585亿吨，同比增长6.6%。

据钢之家消息，焦化企业8月23日上午再次召开市场分析会，与会企业一致认为焦炭并不具备降价条件。为保障客户焦炭品质和供应的稳定，完全不同意此轮焦炭降价。

据找钢网库存分析，截至8月23日当周，建材库存转降，表需回升，其中建材产量332.36万吨，周环比增2.25万吨，升0.68%；建材表需342.66万吨，周环比增17.51万吨，升5.39%。

据中国钢铁工业协会数据显示，2023年8月中旬，重点统计钢铁企业共生产粗钢2214.98万吨、生铁1997.08万吨、钢材2154.99万吨。其中粗钢日产221.50万吨，环比增长2.80%。

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。