

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年12月01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	3913	17	0.44%	-21	-0.53%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4007	1	0.02%	-7	-0.17%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	4020	-20	-0.50%	-40	-0.99%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3970	0	0	10	0.25%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	107	-37		-19	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-37	-1		17	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-3	-24		29	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	-37	-3		27	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	-21	4		-15	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	-4	-4		-20	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	24	20		-14	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	41	7		-7	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	94	-16		14	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	77	-8		19	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	60	5		12	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	4250	-20	-0.47%	-40	-0.93%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4350	-30	-0.68%	-140	-3.12%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4790	-10	-0.21%	-20	-0.42%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3630	0	0	-20	-0.55%
	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	%	79.67	——		-1.34	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	235.47	——		-3.25	-1.36%
	盈利钢厂比例	%	39.39	——		10.39	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	260.90	——		6.06	2.38%
	热卷产量	万吨	326.48	——		6.57	2.05%
独立电弧炉钢厂开工情况（周度）	产能利用率	%	63.44	——		4.23	
	开工率	%	74.22	——		1.03	
	电炉钢厂螺纹钢产量	万吨	82.56	——		35.11	73.99%
库存（周度）	五大品种社会库存	万吨	887.76	——		-9.41	-1.05%
	螺纹社会库存	万吨	360.27	——		2.03	0.57%
	热卷社会库存	万吨	249.56	——		-6.91	-2.69%
	五大品种钢厂库存	万吨	421.13	——		8.32	2.02%
	螺纹钢厂库存	万吨	168.32	——		6.73	4.16%
	热卷钢厂库存	万吨	91.06	——		2.28	2.57%
	唐山地区钢坯库存	万吨	121.56	——		-6.16	-4.82%
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	21.03	0.00	0.01%	0.21	1.01%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	16800	——		-100	-0.59%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	15270	0		0	
	热卷注册仓单数量	吨	304053	0		0	
基本面概述	目前市场各种消息和传闻较多，对行情扰动加大。前期市场关注的焦点是房地产支持政策的推出情况，价格大幅上涨已经充分反应了这方面的利多。MySteel公布的数据显示，本周螺纹产量小幅回升，表观需求继续下滑，库存有所增长，或进入季节性累库周期。从技术面看，期价跌穿下方10日均线的支撑，后市大概率转为震荡，短线反弹之后将继续调整						
操作建议	充分调整后可短线做多，追涨杀跌须谨慎						

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	970	6	0.62%	-8	-0.82%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	953	8	0.85%	-6	-0.63%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	969.5	14.0	1.47%	-7.0	-0.72%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	130.97	1.07	0.82%	-2.30	-1.73%
	普氏62%指数	美元/干吨	132.05	1.60	1.23%	-2.75	-2.04%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	0.5	-8.0		-1.0	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	-16.5	-6.0		1.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	-108.5	-3.5		-7.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	51.5	5.5		12.5	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	163	-6	-3.55%	-5	-2.98%

品种价差	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	149	-6	-3.87%	0	0
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	92	-3	-3.16%	-8	-8.00%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	122	2	1.67%	-10	-7.58%
	普氏65%-62%	美元/干吨	10.9	-1.60		-1.60	
	普氏62%-58%	美元/干吨	14	1.60		-0.90	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1628.4	—		-157.7	-8.83%
	巴西铁矿石发货量	万吨	687.4	—		-1.5	-0.22%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	11.74	0.10	0.86%	2.30	24.36%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	28.01	1.14	4.24%	6.47	30.04%
	美元指数		103.5064	0.6446	0.63%	-0.2545	-0.25%
	美元兑人民币即期		7.135	0.0105	0.15%	-0.0135	-0.19%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1488.7	—		179.7	13.73%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	301.54	—		-0.90	-0.30%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	11309.1	—		82.20	0.73%
	港口贸易库存	万吨	6693.28	—		35.38	0.53%
	进口矿烧结粉总库存：64家样本钢厂	万吨	1094.06	—		2.48	0.23%
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	50.65	—		0.58	1.16%
期货仓单	数量	张	2200	0		0	
基本面概述	目前市场各种消息和传闻较多，政策面对铁矿石有打压，对行情扰动加大。前期市场关注的焦点是房地产支持政策的推出情况，价格大幅上涨应已经充分反应了这方面的利多。近期海外铁矿石发运量上升，海运费上涨，铁矿石到港量上升，疏港量下降，库存继续上涨。从技术面看，期价跌穿下方10日均线的支撑，后市转为高位震荡概率大。						
操作建议	稳健者维持观望，不可追涨杀跌						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/12/1

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	985	+9	985	+10	994	+9	1000	+6	993	+8	987	+10	1020	+12
卡拉加斯粉	1078	+8	1077	+7	1091	+13	1103	+4	1095	+12	1082	+12	1120	+10
巴混63.0%	1010	+10	1010	+10	1013	+8	1052	+8	1013	+8	1013	+13	1040	+10
巴混62.5%	1005	+10	1004	+10	1008	+8	1042	+8	1008	+8	1008	+13	1035	+12
纽曼粉	995	+9	997	+10	1003	+8	1015	+6	1003	+5	997	+10	1030	+12
麦克粉	970	+6	969	+6	975	+11	986	+4	976	+11	973	+8	1010	+12
金布巴粉60.5%	953	+8	953	+9	963	+8	978	+8	963	+8	953	+12	985	+12
金布巴粉59.5%	943	+8	943	+9	953	+8	968	+8	953	+8	943	+12	970	+12
罗伊山粉	955	+9	958	+10	968	+8	968	+8	968	+8	—	—	1000	+11
IOC6	954	+5	955	+5	958	+8	981	+6	958	+8	955	+5	995	+12
FMG混合粉	920	+10	920	+7	933	+6	931	+6	933	+8	920	+9	935	+7
超特粉	864	+9	863	+8	873	+5	875	+6	873	+5	—	—	885	+7
杨迪粉	939	+2	939	+2	933	+8	945	+18	933	+8	939	+2	965	+12
卡拉拉精粉	1153	+10	1153	+10	—	—	1121	+4	—	—	—	—	1160	+10
乌克兰精粉	1155	+5	—	—	1158	+15	—	—	1158	+15	1175	+10	—	—
KUMBA	1040	+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：966.5

	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	27.5	33.5	26.5	20.5	53.5
卡拉加斯粉	111.5	110.5	124.5	136.5	128.5	115.5	153.5
巴混63.0%	43.5	43.5	46.5	85.5	46.5	46.5	73.5
巴混62.5%	38.5	37.5	41.5	75.5	41.5	41.5	68.5
纽曼粉	28.5	30.5	36.5	48.5	36.5	30.5	63.5
麦克粉	3.5	2.5	8.5	19.5	9.5	6.5	43.5
金布巴粉60.5%	-13.5	-13.5	-3.5	11.5	-3.5	-13.5	18.5
金布巴粉59.5%	-23.5	-23.5	-13.5	1.5	-13.5	-23.5	3.5
罗伊山粉	-11.5	-8.5	1.5	1.5	1.5	—	33.5
IOC6	-12.5	-11.5	-8.5	14.5	-8.5	-11.5	28.5
FMG混合粉	-46.5	-46.5	-33.5	-35.5	-33.5	-46.5	-31.5
超特粉	-102.5	-103.5	-93.5	-91.5	-93.5	—	-81.5
杨迪粉	-27.5	-27.5	-33.5	-21.5	-33.5	-27.5	-1.5
卡拉拉精粉	186.5	186.5	—	154.5	—	—	193.5
乌克兰精粉	188.5	—	191.5	—	191.5	208.5	—
KUMBA	73.5	—	—	—	—	—	—

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

据中物联钢铁物流专业委员会，11月钢铁行业PMI为48.2%，环比上升2.6个百分点，结束连续3个月在45%左右运行态势，显示钢铁行业运行短期内有所趋稳。

据兰格钢铁，宝武鄂钢计划于2023年12月15日-2024年1月13日对2#高炉进行年修30天，预计影响日均铁水产量约0.67万吨，预计影响成材品种产量约25万吨，其中预计影响建筑钢材产量18万吨，影响中厚板产量7万吨。

据焦作市生态环境局，11月29日晚，市污染防治攻坚战办发布紧急通知，决定自11月30日18时起，启动我市重污染天气黄色预警（Ⅲ级响应），解除时间另行通知。应急响应期间，我市各工业企业要严格按照要求落实减排措施。矿山、砂石料厂、石材厂、石板厂等停止露天作业。

邯郸市重污染天气应急指挥部决定12月2日8时起启动重污染天气Ⅱ级应急响应，在确保安全生产和民生保障的前提下，全市域严格按照应急减排有关要求落实各项应急减排措施。解除时间根据会商研判结果另行通知。

据Mysteel，截至11月30日当周，表需连续第四周下降，厂库、产量以及社库由降转增，螺纹产量260.90万吨，较上周增加6.06万吨，增幅为2.38%；螺纹表需252.14万吨，较上周减少14.75万吨，降幅为5.53%。

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。