

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年12月07日08时46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	3953	83	2.14%	57	1.46%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4028	57	1.44%	22	0.55%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	4020	10	0.25%	-20	-0.50%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	3980	20	0.51%	10	0.25%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	67	-73		-77	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-48	-37		-12	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	20	7		-1	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	-32	8		2	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	-35	-6		-10	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	-9	-13		-9	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	15	-1		11	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	41	5		7	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	101	-4		-9	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	75	3		-10	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	49	-3		-6		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	4250	10	0.24%	-20	-0.47%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4380	10	0.23%	0	0
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4780	0	0	-20	-0.42%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3620	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	%	80.12	——		0.45	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	235.33	——		-0.14	-0.06%
	盈利钢厂比例	%	39.39	——		0	
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	%	63.97	——		0.53	
	开工率	%	74.64	——		0.42	
	电炉钢厂螺纹钢产量	万吨	80.52	——		33.07	69.68%
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	16.10	-3.94	-19.67%	-4.93	-23.45%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	16500	——		-300	-1.79%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	13769	-2396		-1501	
	热卷注册仓单数量	吨	313814	6846		9761	
基本面概述	目前市场政策面以及消息面变动多, 短线波动加大。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, 上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日均线的支撑后企稳回升, 短线走强, 但中期可能转为震荡或者震荡偏强的走势						
操作建议	多单轻仓持有, 逢高及时止盈离场。						

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	976	10	1.04%	12	1.24%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	958	9	0.95%	13	1.38%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	980	14.0	1.45%	24.5	2.56%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	131.65	2.60	2.01%	-1.04	-0.78%
	普氏62%指数	美元/干吨	133.65	2.25	1.71%	3.20	2.45%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-4	-4.0		-12.5	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-22	-5.0		-11.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	-112.5	9.0		-7.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	50	-9.0		4.0	
	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	169	1	0.60%	0	0

品种价差	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	154	0	0	-1	-0.65%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	89	-1	-1.11%	-6	-6.32%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	123	0	0	0	0
	普氏65%-62%	美元/干吨	10.05		-2.25		-2.45
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.1		2.25		2.70
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1533.9			-94.5	-5.80%
	巴西铁矿石发货量	万吨	847.8			160.4	23.33%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	13.29	0.11	0.83%	1.65	14.18%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	33.68	-1.30	-3.72%	6.81	25.34%
	美元指数		104.1779	0.2305	0.22%	1.3161	1.28%
	美元兑人民币即期		7.159	0.0110	0.15%	0.0345	0.48%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1181			-307.7	-20.67%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	305.78			4.24	1.41%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	11497.66			188.56	1.67%
	港口贸易矿库存	万吨	6732.34			39.06	0.58%
	进口矿烧结粉矿总库存：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	50.4			-0.25	-0.49%
期货仓单	数量	张	2100		0		-100
基本面概述	目前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，价格大幅上涨已经充分反应了这方面的利多。近期海外铁矿石发运量回落，海运费上涨，铁矿石到港量回落，疏港量小幅增加，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，短线有可能逐步企稳						
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）

2023/12/7

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	989	+9	989	+9	1000	+12	1003	+12	1000	+13	993	+10	1030	+7
卡拉加斯粉	1078	+8	1078	+8	1085	+5	1097	+4	1090	+10	1080	+10	1130	+11
巴混63.0%	1013	+9	1013	+9	1020	+13	1056	+12	1020	+13	1013	+10	1050	+5
巴混62.5%	1008	+9	1008	+9	1015	+13	1046	+12	1015	+13	1008	+10	1045	+10
纽曼粉	1001	+9	1001	+9	1010	+12	1018	+12	1012	+15	1003	+10	1040	+7
麦克粉	976	+10	976	+10	983	+13	992	+8	980	+9	980	+11	1020	+7
金布巴粉60.5%	958	+9	957	+7	973	+13	978	+8	973	+13	959	+8	990	+5
金布巴粉59.5%	948	+9	947	+7	963	+13	968	+8	963	+13	949	+8	975	+5
罗伊山粉	959	+9	963	+9	975	+13	970	+6	975	+13			1010	+7
IOC6	958	+9	952	+2	965	+13	984	+12	965	+13	952	+2	1005	+7
FMG混合粉	925	+5	925	+7	943	+10	943	+13	943	+10	925	+6	941	+8
超特粉	865	+10	866	+9	879	+9	880	+12	879	+9			888	+8
杨迪粉	948	+5	948	+5	943	+10	948	+12	943	+10	948	+5	975	+7
卡拉拉精粉	1153	+5	1153	+5			1115	+4					1170	+10
乌克兰精粉	1165	+15			1160	+6			1160	+6	1175	+5		
KUMBA	1050	+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：940.0

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	49	49	60	63	60	53	90
卡拉加斯粉	138	138	145	157	150	140	190
巴混63.0%	73	73	80	116	80	73	110
巴混62.5%	68	68	75	106	75	68	105
纽曼粉	61	61	70	78	72	63	100
麦克粉	36	36	43	52	40	40	80
金布巴粉60.5%	18	17	33	38	33	19	50
金布巴粉59.5%	8	7	23	28	23	9	35
罗伊山粉	19	23	35	30	35		70
IOC6	18	12	25	44	25	12	65
FMG混合粉	-15	-15	3	3	3	-15	1
超特粉	-75	-74	-61	-60	-61		-52
杨迪粉	8	8	3	8	3	8	35
卡拉拉精粉	213	213		175			230
乌克兰精粉	225		220		220	235	
KUMBA	110						

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

力拓计划2024年到2026年每年资本投资100亿美元左右，明显高于过去5年50亿-74亿美元的平均年支出水平。

国家发改委发布《关于建立煤矿产能储备制度的实施意见（征求意见稿）》。其中提出，到2027年，初步建立煤矿产能储备制度，有序核准建设一批产能储备煤矿项目，形成一定规模的可调度煤炭产能储备。

据中钢协统计，2023年11月下旬，重点统计钢铁企业共生产粗钢2016.06万吨、生铁1874.53万吨、钢材2179.66万吨。

据界面新闻，12月5日，2024年度全国煤炭交易会在河北省唐山市开幕。在开幕式上，32家大型煤炭供需企业现场签订了2024年度煤炭中长期合同，合同总量4亿吨左右。

据FMG中国官微报道，12月4日，Fortescue在非洲加蓬创造了历史。随着Fortescue贝林加铁矿石项目的第一船铁矿石完成装船并顺利发运，标志着Fortescue首次从澳大利亚以外的港口出口铁矿石。

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。