

山金期货黑色板块日报

更新时间：2022年08月16日08时29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	4126	-24	-0.58%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4039	-48	-1.17%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	4250	30	0.71%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	4010	-10	-0.25%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	124	54	50
	热轧卷板主力基差	元/吨	-29	38	10
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	223	38	74
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	124	22	33
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	66	8	7
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	64	-4	-4
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-289	-46	-81
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-188	-18	-29
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	12	-8	-9
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	14	4	2
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	4660	40	0.87%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4650	0	0
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4460	0	0
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3760	-10	-0.27%
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2720	50	1.87%
钢厂高炉生产及盈利情况 (周度)	247家钢厂高炉开工率	%	72.7	——	1.09
	247家钢厂日均铁水量	万吨	214.31	——	0.73
	盈利钢厂比例	%	54.55	——	35.50
产量 (周度)	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	252.88	——	7.29
	热卷产量	万吨	300.69	——	0.73
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	产能利用率	%	44.81	——	1.90
	开工率	%	57.34	——	1.00
	电炉钢厂螺纹钢产量	万吨	48.96	——	1.51
库存 (周度)	五大品种社会库存	万吨	1227.84	——	-45.43
	螺纹社会库存	万吨	569.15	——	-33.88
	热卷社会库存	万吨	276.38	——	-2.97
	五大品种钢厂库存	万吨	474.51	——	-1.25
	螺纹钢厂库存	万吨	213.59	——	-2.73
	热卷钢厂库存	万吨	83.2	——	1.75
	唐山地区钢坯库存	万吨	109.15	——	-9.95
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	10.93	-2.88	-20.86%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	10100	——	-700
期货仓单	螺纹钢注册仓单数量	吨	15628	0	6615
	热卷注册仓单数量	吨	18609	0	1478
基本面概述	虽然昨日央行推出缩量续作MLF及下调逆回购利率10个BP, 但市场的影响轻微, 并未有效提振市场的信心。目前主要的问题在房地产仍处于筑底过程中, 尚难见到新开工面积快速回升的可能, 对钢材的需求存在非常大的不确定性。从最新的数据看, 产量连续三周增加, 社库连续第八周减少, 厂库连续第七周减少, 表需由增转减。长、短流程钢厂利润均有所改善, 但长流程钢厂复产偏谨慎, 以检修结束正常复产为主, 铁水产量恢复速度较慢, 建材产量的上升主要是短流程钢厂复产导致。最新公报的金融数据显示, 居民侧加杠杆意愿不足, 而基建投资所带来的需求增量相对有限。				
操作建议	暂时维持观望, 待合适时机逢高中线做空, 短线逢低做多为主。				

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	749	-11	-1.45%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	726	-19	-2.55%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	730.5	0	7.5
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	110.37	-1.91	-1.70%
	普氏62%指数	美元/干吨	108.85	-1.75	-1.58%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	18.5	-11.0	-33.5
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-4.5	-19.0	-31.5
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	80.5	9.5	21.5
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	20.5	-2.0	1.5

品种价差	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	129	-2	-1.53%	0	0
	纽曼块粉价差 (日照港)	元/湿吨	118	-5	-4.07%	-3	-2.48%
	卡拉加斯粉-PB粉 (日照港)	元/吨	112	-5	-4.27%	-6	-5.08%
	PB-超特粉 (日照港)	元/吨	130	-12	-8.45%	-4	-2.99%
	普氏65%-62%	美元/干吨	11.5	0		0	
	普氏62%-58%	美元/干吨	16.2	-0.55		1.90	
海外铁矿石发货量 (周度)	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1667.2	—		105.1	6.73%
	巴西铁矿石发货量	万吨	632.2	—		-172.2	-21.41%
海运费与汇率	BCI运价: 西澳-青岛	美元/吨	8.27	-0.61	-6.87%	0.48	6.16%
	BCI运价: 图巴朗-青岛	美元/吨	21.42	-0.64	-2.90%	-0.99	-4.42%
	美元指数		106.5004	0.8120	0.77%	0.1169	0.11%
	美元兑人民币即期		6.7755	0.0325	0.48%	0.0247	0.37%
铁矿石到港量与疏港量 (周度)	北方六港到港量合计	万吨	1517	—		362.4	31.39%
	日均疏港量 (45港口合计)	万吨	272.85	—		4.81	1.79%
铁矿石库存 (周度)	港口库存合计	万吨	13886.16	—		182.18	1.33%
	港口贸易矿库存	万吨	8263.73	—		277.55	3.48%
	进口矿烧结粉矿总库存: 64家样本钢厂	万吨	1256.15	—		-74.86	-5.62%
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	50.88	—		0.30	0.59%
期货仓单	数量	张	2400	0		700	
基本面概述	近期钢厂亏损面大幅改善, 但长流程钢厂复产谨慎, 以检修结束后正常复产为主, 铁水产量有所上升, 长流程钢厂补库需求并没有涌现, 厂库继续下降。在消费旺季到来时, 前期多头的乐观预期存在落空的风险。目前港口库存及贸易矿的库存继续上升。最新数据显示, 发运量有所回落, 到港量上升。从供求角度看, 目前处于港口阶段性累库、供应边际宽松的状态。短期来看, 价格反弹之后, 继续上涨还需要螺纹等终端产品以及利润改善的带动, 持仓量下降, 显示资金有离场迹象, 不过较大的基差或对期价有一定支撑						
操作建议	行情维持宽幅震荡概率大, 建议维持观望						

铁矿石粉矿现货品牌价格 (元/湿吨)

2022/8/16

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	780	-6	762	-16	785	-12	796	-9	785	-12	782	-5	800	-10
卡拉加斯粉	885	-7	874	-21	920	-7	914	-9	920	-7	903	-5	909	-1
巴混63.0%	840	-6	822	-16	843	-12	861	-9	843	-12	838	-8	875	-9
巴混62.5%	820	-6	802	-16	823	-12	841	-9	823	-12	818	-8	860	-9
纽曼粉	790	-6	778	-13	795	-15	812	-9	795	-15	791	-5	823	-9
麦克粉	760	-15	748	-18	769	-5	776	-5	769	-5	765	-10	766	-9
金布巴粉60.5%	745	-4	724	-21	740	-11	745	-9	740	-11	741	-9	759	-4
金布巴粉59.5%	729	-4	708	-21	730	-11	735	-9	730	-11	729	-5	739	-4
罗伊山粉	755	-6	737	-16	750	-12	758	-9	750	-12	—	—	763	-9
IOC6	752	-9	735	-16	765	-12	781	-9	765	-12	751	-8	740	-50
FMG混合粉	708	-5	697	-11	708	-6	707	-6	708	-6	707	-6	731	-7
超特粉	638	-13	632	-4	645	-13	655	-5	650	-8	—	—	668	-7
杨迪粉	730	-11	717	-16	750	-6	737	-5	750	-6	733	-8	735	-10
卡拉拉精粉	1029	0	1020	-9	—	—	1033	-9	—	—	—	—	980	-10
乌克兰精粉	1125	-10	—	—	1021	-7	—	—	1021	-7	1059	0	—	—
KUMBA	895	-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 708.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	71.5	53.5	76.5	87.5	76.5	73.5	91.5
卡拉加斯粉	176.5	165.5	211.5	205.5	211.5	194.5	200.5
麦克粉	51.5	39.5	60.5	67.5	60.5	56.5	57.5
金布巴粉60.5%	36.5	15.5	31.5	36.5	31.5	32.5	50.5
金布巴粉59.5%	20.5	-0.5	21.5	26.5	21.5	20.5	30.5
罗伊山粉	46.5	28.5	41.5	49.5	41.5	—	54.5
IOC6	43.5	26.5	56.5	72.5	56.5	42.5	31.5
FMG混合粉	-0.5	-11.5	-0.5	-1.5	-0.5	-1.5	22.5
超特粉	-70.5	-76.5	-63.5	-53.5	-58.5	—	-40.5
杨迪粉	21.5	8.5	41.5	28.5	41.5	24.5	26.5
卡拉拉精粉	320.5	311.5	—	324.5	—	—	271.5
乌克兰精粉	416.5	—	312.5	—	312.5	350.5	—
KUMBA	186.5	—	—	—	—	—	—

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

中钢协统计显示，8月上旬，重点统计钢铁企业粗钢日产194.33万吨，环比增长2.81%；生铁日产179.00万吨，环比增长2.01%；钢材日产194.26万吨，环比增长2.89%。

中国7月70个大中城市房价数据出炉，房价下降的城市个数略增，一线房价环比微涨、同比涨幅回落，二三线城市环比整体呈降势、同比降幅扩大。另外，中国1-7月房地产开发投资同比下降6.4%，商品房销售面积下降23.1%，降幅均较上月有所扩大。统计局新闻发言人付凌晖表示，房地产市场总体下行态势趋缓，当前整体上处于筑底阶段。随着房地产市场长效机制不断完善，因城施策效果逐步显现，房地产市场有望逐步企稳。业内人士分析认为，8月以来各地住房支持性政策仍在加码，预计后续市场信心将会逐步提升，房价跌幅有望收窄。

作者：朱美侠
期货从业资格证号：F3049372
投资咨询从业资格证号：Z0015621
电话：021-20627563
邮箱：zhumeixia@sd-gold.com

审核：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。