

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年06月02日08时23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	3546	83	2.40%	114	3.32%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3664	83	2.32%	132	3.74%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	3570	60	1.71%	60	1.71%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	3790	50	1.34%	40	1.07%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	24	-23		-54	
	热轧卷板主力基差	元/吨	126	-33		-92	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	66	12		18	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	79	3		11	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	34	-1		2	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	56	5		3	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-100	-11		-20	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-135	-8		-14	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	105	9		25	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	83	3		24	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	118	0		18		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	3830	20	0.52%	0	0
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4360	0	0	-50	-1.13%
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4360	0	0	-30	-0.68%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3330	30	0.91%	30	0.91%
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2410	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	%	82.36	——		1.26	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	239.36	——		0.11	0.05%
	盈利钢厂比例	%	34.2	——		0.87	
产量 (周度)	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	270.38	——		3.76	1.41%
	热卷产量	万吨	315.31	——		6.35	2.06%
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	产能利用率	%	49.37	——		1.15	
	开工率	%	67.29	——		1.97	
	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	1244.13	——		0	0
	螺纹社会库存	万吨	617.63	——		0	0
	热卷社会库存	万吨	277.08	——		0	0
	五大品种钢厂库存	万吨	497.47	——		-0.10	-0.02%
	螺纹钢厂库存	万吨	230.61	——		0	0
	热卷钢厂库存	万吨	87.4	——		0	0
	唐山地区钢坯库存	万吨	75.17	——		-13.29	-15.02%
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	15.55	-5.15	-24.88%	-4.06	-20.69%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	12500	——		0	0
期货仓单	螺纹钢注册仓单数量	吨	32982	0		0	
	热卷注册仓单数量	吨	34792	0		-1768	
基本面概述	目前市场对政策面预期乐观, 但即使推出提振房地产市场的政策, 效果有待观望。本周螺纹产量继续上涨, 库存继续缓慢回落, 表观需求回升。下游需求即将进入消费淡季, 价格仍承受下行压力。技术面上, 价格突破上方10日均线的阻力, 短线有见底迹象, 但中期下行趋势难言转变						
操作建议	中线空单持有, 短线以逢高做空为主						

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	789	27	3.54%	57	7.79%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	756	21	2.86%	47	6.63%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	743	32.0	4.50%	62.0	9.10%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	102.08	0.85	0.84%	2.10	2.10%
	普氏62%指数	美元/干吨	103.2	0.55	0.54%	5.85	6.01%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	46	-5.0		-5.0	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	13	-11.0		-15.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	59.5	3.5		10.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	26.5	0.5		7.5	
	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	111	3	2.78%	1	0.91%
	纽曼块粉价差 (日照港)	元/湿吨	92	1	1.10%	-2	-2.13%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉 (日照港)	元/吨	93	-5	-5.10%	-6	-6.06%
	PB-超特粉 (日照港)	元/吨	129	2	1.57%	1	0.78%
	普氏65%-62%	美元/干吨	11.8	0		-1.20	
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.05	0.45		1.60	
海外铁矿石发货量 (周度)	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1470.3	——		-235.7	-13.82%
	巴西铁矿石发货量	万吨	702.8	——		84.1	13.59%
海运费与汇率	BCI运价: 西澳-青岛	美元/吨	8.12	-0.21	-2.52%	-0.68	-7.73%
	BCI运价: 图巴朗-青岛	美元/吨	19.27	-0.28	-1.43%	-1.36	-6.59%
	美元指数		104.228	0.1751	0.17%	0.3337	0.32%
	美元兑人民币即期		7.109	0.0302	0.43%	0.0485	0.69%
铁矿石到港量与疏港量 (周度)	北方六港到货量合计	万吨	1102.9	——		-19.0	-1.69%
	日均疏港量 (45港口合计)	万吨	291.705	——		4.79	1.67%
铁矿石库存 (周度)	港口库存合计	万吨	12793.83	——		7.62	0.06%
	港口贸易矿库存	万吨	7635.39	——		29.16	0.38%
	进口矿烧结粉总库存: 64家样本钢厂	万吨	936.69	——		-17.21	-1.80%
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	47.48	——		-0.39	-0.81%
期货仓单	数量	张	2000	0		-200	
基本面概述	近期钢厂亏损面有所收窄, 高炉铁水产量小幅回升。表观需求环比上升, 钢材社会库存继续下降, 但去库速度不及预期。最新数据显示, 铁矿石发运量回落, 海运费有所下降, 到港量上升, 港口库存上升, 疏港量有所上升。铁矿石较大的基差对期价有一定的支撑作用。钢厂铁矿石库存较低, 对价格也有支撑。整体来看, 铁矿石供需矛盾不突出, 期价大概率跟随螺纹价格走势。						
操作建议	短线可进行高抛低吸操作, 中线操作需要等待逢高做空的机会出现						

铁矿石粉矿现货品牌价格 (元/湿吨)

2023/6/2

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	802	+25	802	+25	819	+22	836	+29	820	+22	813	+33	830	+25
卡拉加斯粉	895	+28	895	+20	944	+17	944	+29	940	+27	895	+20	935	+23
巴混63.0%	827	+25	829	+25	840	+22	870	+29	840	+22	834	+33	870	+25
巴混62.5%	822	+25	823	+25	830	+22	860	+29	830	+22	828	+33	860	+25
纽曼粉	818	+23	818	+24	836	+21	845	+29	838	+26	823	+24	850	+30
麦克粉	789	+27	789	+29	801	+24	808	+28	798	+23	803	+33	815	+28
金布巴粉60.5%	756	+21	756	+21	785	+30	775	+25	780	+25	761	+21	795	+30
金布巴粉59.5%	746	+21	746	+21	775	+30	765	+25	770	+25	751	+21	780	+30
罗伊山粉	784	+18	784	+25	795	+22	795	+29	795	+22	——	——	800	+25
IOC6	775	+25	779	+19	795	+22	811	+29	795	+22	769	+19	810	+25
FMG混合粉	725	+12	725	+12	732	+24	728	+19	733	+24	725	+13	753	+8
超特粉	673	+23	673	+23	675	+21	680	+23	675	+21	——	——	700	+20
杨迪粉	750	+23	750	+22	733	+24	748	+23	733	+24	750	+22	765	+20
卡拉拉精粉	926	+10	918	+10	——	——	961	+29	——	——	——	——	915	+25
乌克兰精粉	#N/A	#N/A	——	——	998	+27	——	——	998	+27	940	+10	——	——
KUMBA	#N/A	#N/A	——	——	——	——	——	——	——	——	——	——	——	——

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: **736.5**

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	65.5	65.5	82.5	99.5	83.5	76.5	93.5
卡拉加斯粉	158.5	158.5	207.5	207.5	203.5	158.5	198.5
巴混63.0%	90.5	92.5	103.5	133.5	103.5	97.5	133.5
巴混62.5%	85.5	86.5	93.5	123.5	93.5	91.5	123.5
纽曼粉	81.5	81.5	99.5	108.5	101.5	86.5	113.5
麦克粉	52.5	52.5	64.5	71.5	61.5	66.5	78.5
金布巴粉60.5%	19.5	19.5	48.5	38.5	43.5	24.5	58.5
金布巴粉59.5%	9.5	9.5	38.5	28.5	33.5	14.5	43.5
罗伊山粉	47.5	47.5	58.5	58.5	58.5	——	63.5
IOC6	38.5	42.5	58.5	74.5	58.5	32.5	73.5
FMG混合粉	-11.5	-11.5	-4.5	-8.5	-3.5	-11.5	16.5
超特粉	-63.5	-63.5	-61.5	-56.5	-61.5	——	-36.5
杨迪粉	13.5	13.5	-3.5	11.5	-3.5	13.5	28.5
卡拉拉精粉	189.5	181.5	——	224.5	——	——	178.5
乌克兰精粉	#N/A	——	261.5	——	261.5	203.5	——
KUMBA	#N/A	——	——	——	——	——	——

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

据隆众资讯，截止到6月1日，全国浮法玻璃样本企业总库存 5553.7万重箱，环比增加336.6万重箱，增幅6.45%，同比下滑26.15%。

中国煤炭运销协会组织召开煤钢行业市场研讨会认为，当前钢铁生产企业下游用户需求不足，钢铁行业出现大面积亏损，同时，焦煤的市场价格与长协价格出现了较大差距，煤钢焦市场处于明显的下行趋势。

钢协副会长骆铁军表示，通过近期的调研，企业普遍认为，当前钢铁市场不太可能如2008及2015年后迎来新一轮上升走势。房地产是影响钢铁需求的关键变量，螺纹钢是影响钢材总体价格走势的标杆。如全行业不进行有效的产量控制，未来钢铁行业可能在微利边缘徘徊，甚至出现大面积亏损。

据Mysteel，截至6月1日当周，社库连续第十四周减少，产量连续第二周增加，厂库连续第四周减少，表需由降转增。

本周Mysteel煤焦事业部调研全国30家独立焦化厂吨焦盈利情况，全国平均吨焦盈利1元/吨；山西准一级焦平均盈利46元/吨，山东准一级焦平均盈利-32元/吨。

南非国有铁路运营商Transnet Freight Rail于周三发表声明称，由于电缆盗窃，其主要铁矿石铁路线已暂停运营。该铁路是南非铁矿石出口的主要通道。

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。