

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年07月21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	3784	43	1.15%	57	1.53%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3887	44	1.14%	58	1.51%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3730	10	0.27%	30	0.81%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3900	30	0.78%	40	1.04%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	-54	-33		-27	
	热轧卷板主力基差	元/吨	13	-14		-18	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	43	-13		-25	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	65	-3		-13	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	63	1		-8	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	65	-5		-11	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-106	12		33	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-130	8		24	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	81	-9		-11	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	79	-3		-8	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	103	1		1	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	3960	0	0	0	0
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4430	50	1.14%	40	0.91%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4560	30	0.66%	60	1.33%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3570	20	0.56%	50	1.42%
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2490	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	%	84.48	——		0.39	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	246.82	——		-0.06	-0.02%
	盈利钢厂比例	%	64.07	——		0.43	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	278.80	——		2.74	0.99%
	热卷产量	万吨	306.98	——		3.47	1.14%
独立电弧炉钢厂开工情况（周度）	产能利用率	%	50.1	——		-0.94	
	开工率	%	68.63	——		1.34	
	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	1168.15	——		10.15	0.88%
	螺纹社会库存	万吨	568.28	——		10.27	1.84%
	热卷社会库存	万吨	281.3	——		-0.01	-0.00%
	五大品种钢厂库存	万吨	451.27	——		-9.71	-2.11%
	螺纹钢厂库存	万吨	202.28	——		-1.36	-0.67%
	热卷钢厂库存	万吨	92.31	——		-3.61	-3.76%
	唐山地区钢坯库存	万吨	63.39	——		3.89	6.54%
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	20.83	0.88	4.39%	0.41	2.03%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	13900	——		800	6.11%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	55516	0		8087	
	热卷注册仓单数量	吨	151487	-1188		18418	
基本面概述	本周螺纹产量上升，表观需求有所上升，库存继续上升上升，在消费淡季，库存大概率维持缓慢上升的节奏。目前房地产市场高竣工、弱销售、低开工的状况仍在继续，前期市场预期的重磅政策仍未落地，最近强预期开始松动。技术面上，期价目前处于震荡收敛的状态，需警惕未来向某个方向突破的可能。						
操作建议	中线可尝试轻仓做空，短线可进行高抛低吸操作，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	868	14	1.64%	13	1.52%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	828	14	1.72%	12	1.47%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	849.5	15.5	1.86%	20.5	2.47%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	114.74	2.39	2.13%	8.98	8.49%
	普氏62%指数	美元/干吨	114	-1.85	-1.60%	3.45	3.12%
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	-1.5		-7.5	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	-21.5	-1.5		-8.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	75	-1.5		-8.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	35.5	-2.0		-5.0	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	106	0	0	4	3.92%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	90	0	0	6	7.14%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	129	-9	-6.52%	-19	-12.84%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	134	2	1.52%	3	2.29%
	普氏65%-62%	美元/干吨	14	0		0	
	普氏62%-58%	美元/干吨	16	-0.55		-0.35	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1582.1	—		66.9	4.42%
	巴西铁矿石发货量	万吨	620.6	—		16.3	2.70%
海运运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	7.64	-0.11	-1.42%	-0.45	-5.56%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	19.5	-0.13	-0.66%	-0.09	-0.46%
	美元指数		100.2809	0.3340	0.33%	-0.3094	-0.31%
	美元兑人民币即期		7.224	0.0364	0.51%	0.0590	0.82%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1222.5	—		-139.3	-10.23%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	315.8	—		2.38	0.76%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	12495.17	—		-143.39	-1.13%
	港口贸易库存	万吨	7759.91	—		56.15	0.73%
	进口矿烧结粉总库存：64家样本钢厂	万吨	865.88	—		-56.27	-6.10%
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	50.18	—		1.40	2.87%
期货仓单	数量	张	3200	0		-1300	
基本面概述	近期钢厂亏损面有所扩大，另外，目前钢厂停产检修增加，高炉铁水产量环比有所回落。钢材表观需求环比回落，钢材社会库存上升。最新数据显示，铁矿石发运量上升，海运费回落，到港量上升，港口库存下降，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。人民币的走强对期价形成一定的压力。整体来看，铁矿石供需相对偏紧，期价大概率跟随螺纹价格走势，但较螺纹相对更强。						
操作建议	短线可进行高抛低吸，稳健者维持观望						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/7/21

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	886	+14	886	+14	903	+13	906	+15	908	+13	889	+11	915	+12
卡拉加斯粉	986	+11	1015	+5	1023	+10	1023	+15	1020	+7	1010	+5	1018	+13
巴混63.0%	922	+15	922	+14	938	+13	940	+15	938	+13	918	+11	945	+10
巴混62.5%	916	+14	916	+14	928	+13	930	+15	928	+13	912	+11	940	+10
纽曼粉	904	+15	905	+16	919	+10	915	+15	921	+13	911	+11	930	+12
麦克粉	868	+14	868	+14	878	+15	884	+12	878	+14	870	+8	900	+12
金布巴粉60.5%	828	+14	827	+14	846	+17	853	+13	844	+13	831	+12	862	+9
金布巴粉59.5%	818	+14	817	+14	836	+17	843	+13	834	+13	821	+12	847	+9
罗伊山粉	860	+16	860	+15	883	+13	874	+15	883	+13	—	—	885	+15
IOC6	846	+14	846	+14	868	+3	851	+2	868	+3	846	+21	865	+10
FMG混合粉	785	+5	785	+5	795	+10	792	+2	795	+12	787	+6	822	+2
超特粉	753	+13	752	+12	750	+10	759	+9	750	+10	—	—	785	0
杨迪粉	801	+16	801	+16	795	+12	814	+9	795	+12	801	+16	815	+10
卡拉拉精粉	1028	+8	1028	+10	—	—	1030	+15	—	—	—	—	1003	+13
乌克兰精粉	1040	+5	—	—	1052	+4	—	—	1052	+4	1050	+10	—	—
KUMBA	945	+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：845.0

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	41	41	58	61	63	44	70
卡拉加斯粉	141	170	178	178	175	165	173
巴混63.0%	77	77	93	95	93	73	100
巴混62.5%	71	71	83	85	83	67	95
纽曼粉	59	60	74	70	76	66	85
麦克粉	23	23	33	39	33	25	55
金布巴粉60.5%	-17	-18	1	8	-1	-14	17
金布巴粉59.5%	-27	-28	-9	-2	-11	-24	2
罗伊山粉	15	15	38	29	38	—	40
IOC6	1	1	23	6	23	1	20
FMG混合粉	-60	-60	-50	-53	-50	-58	-23
超特粉	-92	-93	-95	-86	-95	—	-60
杨迪粉	-44	-44	-50	-31	-50	-44	-30
卡拉拉精粉	183	183	—	185	—	—	158
乌克兰精粉	195	—	207	—	207	205	—
KUMBA	100	—	—	—	—	—	—

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

欧盟委员会批准8.5亿欧元资金，支持全球最大钢铁企业安赛乐米塔尔脱碳工作。

据Mysteel，截至7月20日当周，螺纹产量、表需由降转增，厂库由增转降，社库连续第四周增加。其中螺纹表需269.89万吨，较上周增加3.76万吨，增幅1.41%。

据Mysteel最新调研统计，截止7月20日伊金霍洛旗共有11家煤矿暂停生产，核定产能共计3710万吨/年，日均影响产量10.16万吨，停产煤矿表示，具体复工时间待定，预计停产时间3-7天。

据Mysteel调研，唐山89座高炉中有15座检修（包括长期停产未拆除及尚未置换完成的高炉），检修高炉容积合计13560m³；周影响产量约26.99万吨，周度产能利用率为89.43%，较上周环比增加1.71个百分点，较上月同期增加1.33个百分点。

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。