

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月02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	3862	15	0.39%	5	0.13%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4088	4	0.10%	71	1.77%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	3790	0	0	0	0
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	4080	0	0	60	1.49%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	-72	-15		-5	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-8	-4		-11	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-19	-3		-43	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	47	-6		-1	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	123	17		32	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	163	20		70	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-104	-14		11	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-210	-14		-69	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	160	-8		24	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	120	-11		-14	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	226	-11		66		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	4020	0	0	20	0.50%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4490	0	0	40	0.90%
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4680	30	0.65%	70	1.52%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3650	0	0	0	0
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2570	0	0	30	1.18%
钢厂高炉生产及盈利情况 (周度)	247家钢厂高炉开工率	%	83.6	——		-0.73	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	244.27	——		-0.11	-0.05%
	盈利钢厂比例	%	64.5	——		0.43	
产量 (周度)	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	274.12	——		-4.68	-1.68%
	热卷产量	万吨	307.59	——		0.61	0.20%
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	产能利用率	%	50.57	——		0.11	
	开工率	%	72.26	——		0.73	
	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	1181.6	——		13.45	1.15%
	螺纹社会库存	万吨	578.19	——		9.91	1.74%
	热卷社会库存	万吨	282.59	——		1.29	0.46%
	五大品种钢厂库存	万吨	429.57	——		-21.70	-4.81%
	螺纹钢厂库存	万吨	193.02	——		-9.26	-4.58%
	热卷钢厂库存	万吨	83.93	——		-8.38	-9.08%
	唐山地区钢坯库存	万吨	71.49	——		8.10	12.78%
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	18.08	-4.39	-19.55%	-5.83	-24.37%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	13600	——		-100	-0.73%
期货仓单	螺纹钢注册仓单数量	吨	55516	0		0	
	热卷注册仓单数量	吨	148780	305		-298	
基本面概述	政策面上, 有钢厂收到粗钢产量平控要求, 但唐山地区限产政策解除, 整体供应不会出现明显收缩。中央召开经济工作会议后, 市场对房地产信心增强。目前房地产高竣工、弱销售、低开工的状况没有明显改善。上周螺纹产量回落, 表现需求有所上升, 库存继续上升, 在消费淡季, 库存大概率维持缓慢上升的节奏。技术面上, 期价向上突破近期震荡区间后, 维持偏强的走势						
操作建议	短线逢低做多, 及时止盈离场, 中线暂时维持观望, 不建议追涨						

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	855	-1	-0.12%	-20	-2.29%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	826	3	0.36%	-9	-1.08%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	838.5	-3.0	-0.36%	-18.0	-2.10%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	106.03	-3.15	-2.89%	-7.63	-6.71%
	普氏62%指数	美元/干吨	110.05	0.65	0.59%	-4.45	-3.89%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	16.5	2.0		-2.0	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-12.5	6.0		9.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	87.5	-1.0		4.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	26.5	1.5		-6.5	
	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	99	-4	-3.88%	-6	-5.71%

品种价差	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	83	-5	-5.68%	-7	-7.78%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	104	1	0.97%	-21	-16.80%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	141	2	1.44%	1	0.71%
	普氏65%-62%	美元/干吨	13.3	0		0.50	
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.9	0.55		-0.65	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1625.5	—		115.9	7.68%
	巴西铁矿石发货量	万吨	736	—		10.3	1.42%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	7.84	0.16	2.08%	0.22	2.89%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	19.65	0.14	0.72%	0.55	2.88%
	美元指数		101.94	0.0638	0.06%	0.5283	0.52%
	美元兑人民币即期		7.177	0.0335	0.47%	0.0383	0.54%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	967.8	—		-101.1	-9.46%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	313.73	—		-0.12	-0.04%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	12451.96	—		-88.60	-0.71%
	港口贸易矿库存	万吨	7718.76	—		-34.76	-0.45%
	进口矿烧结粉矿总库存：64家样本钢厂	万吨	869.51	—		3.63	0.42%
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	51.04	—		0.86	1.71%
期货仓单	数量	张	2700	0		1200	
	基本面概述	产量平控的要求对铁矿石价格构成一定的压力，但房地产政策面的提振对期价又有支撑。供求方面，目前发货量维持在高位，海运费整体呈下行态势，铁矿石到港量环比下降，港口库存继续下降。随着下游需求存在边际转弱的预期，铁矿石的价格存一定的下行压力。					
操作建议	建议暂时维持观望，不可追涨杀跌						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/8/2

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	875	-2	876	-1	876	-4	893	-1	878	-2	880	-1	893	-2
卡拉加斯粉	967	-2	980	0	994	-5	995	+9	998	-2	980	0	1020	0
巴混63.0%	911	-2	912	-1	908	-2	933	-1	908	-2	912	-1	933	-2
巴混62.5%	905	-2	906	-1	898	-2	923	-1	898	-2	908	-1	928	-2
纽曼粉	893	-1	895	0	898	-8	910	-1	899	-7	902	-1	910	-2
麦克粉	855	-1	856	0	854	-1	868	-2	855	-1	854	+1	884	-2
金布巴粉60.5%	826	+3	827	+3	823	+2	837	-3	824	+4	827	+4	850	+10
金布巴粉59.5%	816	+3	817	+3	813	+2	827	-3	814	+4	817	+4	835	+10
罗伊山粉	847	+2	847	+2	848	-2	861	-1	848	-2	—	—	860	-5
IOC6	835	0	831	-1	843	-2	837	-1	843	-2	831	-1	863	-2
FMG混合粉	777	+2	777	+2	787	+7	788	+8	780	0	777	0	815	-2
超特粉	738	0	735	-3	738	+1	745	+4	738	+2	—	—	778	-2
杨迪粉	788	0	789	0	780	0	800	+4	780	0	789	0	800	-5
卡拉拉精粉	1016	0	1016	0	—	—	1002	+9	—	—	—	—	1005	0
乌克兰精粉	1035	+5	—	—	1028	-2	—	—	1028	-2	1038	0	—	—
KUMBA	940	+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：839.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	35.5	36.5	36.5	53.5	38.5	40.5	53.5
卡拉加斯粉	127.5	140.5	154.5	155.5	158.5	140.5	180.5
巴混63.0%	71.5	72.5	68.5	93.5	68.5	72.5	93.5
巴混62.5%	65.5	66.5	58.5	83.5	58.5	68.5	88.5
纽曼粉	53.5	55.5	58.5	70.5	59.5	62.5	70.5
麦克粉	15.5	16.5	14.5	28.5	15.5	14.5	44.5
金布巴粉60.5%	-13.5	-12.5	-16.5	-2.5	-15.5	-12.5	10.5
金布巴粉59.5%	-23.5	-22.5	-26.5	-12.5	-25.5	-22.5	-4.5
罗伊山粉	7.5	7.5	8.5	21.5	8.5	—	20.5
IOC6	-4.5	-8.5	3.5	-2.5	3.5	-8.5	23.5
FMG混合粉	-62.5	-62.5	-52.5	-51.5	-59.5	-62.5	-24.5
超特粉	-101.5	-104.5	-101.5	-94.5	-101.5	—	-61.5
杨迪粉	-51.5	-50.5	-59.5	-39.5	-59.5	-50.5	-39.5
卡拉拉精粉	176.5	176.5	—	162.5	—	—	165.5
乌克兰精粉	195.5	—	188.5	—	188.5	198.5	—
KUMBA	100.5	—	—	—	—	—	—

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

中国煤炭工业协会公布数据显示，6月末，全国煤炭企业存煤6900万吨，同比增长11.4%；全国火电厂存煤约2.0亿吨，增加约2800万吨，存煤可用约30天，达到历史最高水平。

7月31日唐山环保攻坚战接近尾声，Mysteel对唐山前期停产高炉进行跟踪了解，8月1日至8月2日将有6座高炉陆续复产，复产容积为6480立方米，涉及铁水产量约为1.75万吨/日。

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。