

## 山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月15日08时50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	3641	-50	-1.35%	-91	-2.44%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3889	-48	-1.22%	-95	-2.38%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	3700	0	0	-10	-0.27%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	3890	-40	-1.02%	-90	-2.26%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	59	50		81	
	热轧卷板主力基差	元/吨	1	8		5	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-43	-7		-32	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	45	-4		1	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	62	-7		-34	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	102	-14		-40	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-19	14		66	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-147	18		39	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	160	-1		-37	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	120	6		-31	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	248	2		-4		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	3940	10	0.25%	0	0
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4450	-10	-0.22%	-30	-0.67%
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4680	0	0	0	0
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3480	-40	-1.14%	-80	-2.25%
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2550	0	0	-20	-0.78%
钢厂高炉生产及盈利情况 (周度)	247家钢厂高炉开工率	%	83.36	—		1.22	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	240.98	—		0.29	0.12%
	盈利钢厂比例	%	61.47	—		-3.03	
产量 (周度)	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	265.67	—		-4.11	-1.52%
	热卷产量	万吨	311.71	—		6.45	2.11%
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	产能利用率	%	52.58	—		1.76	
	开工率	%	74.12	—		1.86	
	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	1220.89	—		14.06	1.17%
	螺纹社会库存	万吨	610.67	—		13.09	2.19%
	热卷社会库存	万吨	288.11	—		1.38	0.48%
	五大品种钢厂库存	万吨	454.72	—		17.33	3.96%
	螺纹钢厂库存	万吨	205.26	—		8.49	4.31%
	热卷钢厂库存	万吨	85.81	—		2.31	2.77%
	唐山地区钢坯库存	万吨	64.26	—		-7.36	-10.28%
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	17.21	-3.38	-16.43%	-2.62	-13.20%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	13300	—		1200	9.92%
期货仓单	螺纹钢注册仓单数量	吨	75799	9986		19071	
	热卷注册仓单数量	吨	238321	0		84333	
基本面概述	消息面上, 7月金融数据差于预期, 可能对多头情绪造成打压。政策面上, 粗钢产量平控对当前产量影响小, 房地产政策调整对需求的影响存在时滞, 房地产高竣工、弱销售、低开工的状况没有改善。上周螺纹产量回落, 表现需求大幅下降, 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, 期价大幅回调, 对中线上行趋势已经形成破坏。						
操作建议	中线空单可轻仓持有, 反抽后可加仓						

### 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	810	-11	-1.34%	-10	-1.22%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	792	-11	-1.37%	7	0.89%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	725	-14.0	-1.89%	5.5	0.76%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	100.44	-2.31	-2.25%	-0.29	-0.29%
	普氏62%指数	美元/干吨	105.1	1.75	1.69%	1.35	1.30%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	85	3.0		-15.5	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	67	3.0		1.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	93.5	3.0		-1.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	23	1.0		1.5	
	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	103	4	4.04%	6	6.19%

品种价差	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	86	4	4.88%	4	4.88%
	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	103	0	0	2	1.98%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	128	-3	-2.29%	-7	-5.19%
	普氏65%-62%	美元/干吨	12	0		0	
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.5	0.70		0.65	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1732.7	—		247.8	16.69%
	巴西铁矿石发货量	万吨	804.9	—		274.1	51.64%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	7.85	-0.38	-4.62%	-0.39	-4.73%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	20.18	-0.19	-0.93%	0.16	0.80%
	美元指数		103.1711	0.3051	0.30%	1.0935	1.07%
	美元兑人民币即期		7.258	0.0192	0.27%	0.0638	0.89%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1696.6	—		745.5	78.38%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	316.85	—		16.10	5.35%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	11945.91	—		-344.45	-2.80%
	港口贸易矿库存	万吨	7436.72	—		-132.80	-1.75%
	进口矿烧结粉矿总库存：64家样本钢厂	万吨	887.89	—		24.08	2.79%
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	50.57	—		-0.47	-0.92%
期货仓单	数量	张	2600	0		200	
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，房地产政策面的利多转为下游需求的好转还需要时间。供求方面，目前发货量大幅上升，海运费有所反弹，铁矿石到港量环比大幅上升，疏港量回升，港口库存继续下降，下游需求存在边际好转的预期。整体来看，随着螺纹的下跌，铁矿石的价格存一定的下行压力。						
操作建议	空单可轻仓持有						

**铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）**

2023/8/15

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	828	-14	828	-13	835	-10	855	-10	835	-10	844	-10	855	-10
卡拉加斯粉	932	-11	931	-13	942	-22	951	-17	941	-24	931	-13	965	-10
巴混63.0%	860	-18	860	-17	865	-10	895	-10	865	-10	860	-26	890	-5
巴混62.5%	855	-17	855	-16	855	-10	885	-10	855	-10	855	-27	885	-5
纽曼粉	845	-14	845	-13	848	-16	865	-17	849	-15	854	-10	870	-10
麦克粉	810	-11	808	-12	818	-12	836	-12	817	-13	828	0	835	-15
金布巴粉60.5%	792	-11	793	-7	790	-4	801	-12	792	-6	798	-6	800	-7
金布巴粉59.5%	782	-11	783	-7	780	-4	791	-12	782	-6	788	-6	785	-7
罗伊山粉	798	-14	798	-13	815	-10	823	-10	815	-10	—	—	830	-10
IOC6	788	-7	788	-13	800	-10	776	-15	800	-10	788	-13	818	-19
FMG混合粉	758	-1	758	-2	761	-5	762	-4	761	-5	757	-1	783	-8
超特粉	700	-9	700	-10	698	-12	716	-1	698	-12	—	—	740	-8
杨迪粉	775	-14	779	-10	751	-11	771	-1	751	-11	779	-10	757	-13
卡拉拉精粉	978	-10	978	-10	—	—	958	-17	—	—	—	—	950	-10
乌克兰精粉	1005	-5	—	—	971	-24	—	—	971	-24	1000	-10	—	—
KUMBA	910	-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：729.0

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	99	99	106	126	106	115	126
卡拉加斯粉	203	202	213	222	212	202	236
巴混63.0%	131	131	136	166	136	131	161
巴混62.5%	126	126	126	156	126	126	156
纽曼粉	116	116	119	136	120	125	141
麦克粉	81	79	89	107	88	99	106
金布巴粉60.5%	63	64	61	72	63	69	71
金布巴粉59.5%	53	54	51	62	53	59	56
罗伊山粉	69	69	86	94	86	—	101
IOC6	59	59	71	47	71	59	89
FMG混合粉	29	29	32	33	32	28	54
超特粉	-29	-29	-31	-13	-31	—	11
杨迪粉	46	50	22	42	22	50	28
卡拉拉精粉	249	249	—	229	—	—	221
乌克兰精粉	276	—	242	—	242	271	—
KUMBA	181	—	—	—	—	—	—

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**

克拉克森数据显示，7月全球船舶订单量为333万修正总吨（CGT），同比增加22%，其中韩企接单量为146万CGT，占44%，时隔5个月重返全球首位。中国以113万CGT（34%）紧随其后。

8月7日-8月13日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2579.0万吨，环比增加298.3万吨。澳洲发运量1774.2万吨，环比增加86.1万吨，其中澳洲发往中国的量1551.3万吨，环比增加215.4万吨。巴西发运量804.9万吨，环比增加212.2万吨。本期全球铁矿石发运总量2957.1万吨，环比增加124.2万吨。

8月7日-8月13日中国47港铁矿到港总量3283.2万吨，环比增加1347.9万吨；中国45港铁矿到港总量3180.9万吨，环比增加1313.5万吨；北方六港铁矿到港总量为1696.6万吨，环比增加745.5万吨。

据中钢协，8月上旬，21个城市5大品种钢材社会库存964万吨，环比增加23万吨，上升2.4%，库存连续小幅上升；比年初增加212万吨，上升28.2%；比上年同期减少64万吨，下降6.2%。螺纹钢库存450万吨，环比增加15万吨，上升3.4%，库存连续上升；比年初增加142万吨，上升46.1%；比上4年同期减少8万吨，下降1.7%。

据兰格钢铁网，唐山市局通知，14日晚8点开始调坯轧钢厂停产，解除时间另行通知。

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。