

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年08月28日08时32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	3716	28	0.76%	16	0.43%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3917	33	0.85%	12	0.31%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3730	-10	-0.27%	0	0
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3900	10	0.26%	0	0
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	14	-38		-16	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-17	-23		-12	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-28	-2		-10	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	49	-2		2	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	58	9		-16	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	84	1		-21	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-30	-7		26	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-133	1		19	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	124	5		-16	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	98	13		-11	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	201	5		-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%	-20	-0.51%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4400	-10	-0.23%	-50	-1.12%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4730	0	0	10	0.21%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3550	0	0	20	0.57%
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2550	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	%	84.09	——		0.29	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	245.62	——		2.02	0.83%
	盈利钢厂比例	%	51.08	——		-7.79	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	263.45	——		-0.35	-0.13%
	热卷产量	万吨	318	——		3.34	1.06%
独立电弧炉钢厂开工情况 （周度）	产能利用率	%	54.06	——		-0.64	
	开工率	%	72.98	——		-1.66	
	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	1198.49	——		-12.04	-0.99%
	螺纹社会库存	万吨	589.41	——		-12.71	-2.11%
	热卷社会库存	万吨	290.3	——		0.98	0.34%
	五大品种钢厂库存	万吨	444.78	——		-5.02	-1.12%
	螺纹钢厂库存	万吨	196.93	——		-7.35	-3.60%
	热卷钢厂库存	万吨	86.3	——		0.90	1.05%
	唐山地区钢坯库存	万吨	61.92	——		1.95	3.25%
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	17.95	-4.59	-20.36%	-3.91	-17.90%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	15300	——		200	1.32%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	125227	301		23401	
	热卷注册仓单数量	吨	222178	-3587		-15547	
基本面概述	周末证监会等推出重磅利好，对股市利多，但对商品市场的利好可能相对有限。产业方面，各地粗钢产量平控政策陆续明确，MySteel公布的数据显示，本周螺纹产量回落，表观需求继续上升，库存继续下降，市场逐渐进入旺季，但产量回升速度优先。目前市场是弱宏观与强政策、强需求预期之间的博弈						
操作建议	空单轻仓持有						

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	873	8	0.92%	29	3.44%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	844	6	0.72%	32	3.94%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	827	0	0	55.5	7.19%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	113.77	1.87	1.67%	12.96	12.86%
	普氏62%指数	美元/干吨	114.5	0	0	5.15	4.71%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	46	8.0		-26.5	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	17	6.0		-23.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	65.5	0		-25.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	37.5	0		3.0	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	105	6	6.06%	12	12.90%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	85	0	0	5	6.25%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	82	3	3.80%	-17	-17.17%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	151	-1	-0.66%	25	19.84%
	普氏65%-62%	美元/干吨	11.5	0			-0.35
	普氏62%-58%	美元/干吨	16.1	0			1.50
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1626	—		-106.7	-6.16%
	巴西铁矿石发货量	万吨	725.2	—		-79.7	-9.90%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	7.29	-0.25	-3.32%	-0.64	-8.07%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	19.26	-0.64	-3.22%	-2.08	-9.75%
	美元指数		104.2016	0.2540	0.24%	0.7597	0.73%
	美元兑人民币即期		7.2865	0.0075	0.10%	0.0010	0.01%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1043.8	—		-652.8	-38.48%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	328.19	—		1.47	0.45%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	12032.48	—		-18.51	-0.15%
	港口贸易库存	万吨	7456.93	—		-23.55	-0.31%
	进口矿烧结粉总库存：64家样本钢厂	万吨	925.75	—		56.75	6.53%
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	50.73	—		0.16	0.32%
期货仓单	数量	张	2200	0		0	
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，目前发货量环比小幅回落，海运费有所下降，铁矿石到港量环比大幅回落，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，随着螺纹的上涨以及铁水产量的回升，铁矿石的价格有望维持偏强的走势						
操作建议	维持观望，谨慎追涨						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/8/28

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	894	+5	893	+4	893	+8	894	+6	893	+8	900	+5	910	+5
卡拉加斯粉	975	+7	975	+7	987	+1	990	+9	990	+3	975	+10	1005	+5
巴混63.0%	922	+4	922	+4	923	+8	934	+6	923	+8	920	+10	945	+5
巴混62.5%	917	+4	917	+4	913	+8	924	+6	913	+8	915	+10	940	+5
纽曼粉	909	+6	911	+7	900	+9	906	+6	904	+9	910	+5	925	+5
麦克粉	873	+8	870	+5	880	+7	877	+6	879	+8	873	+3	900	+12
金布巴粉60.5%	844	+6	842	+5	839	+5	844	+8	843	+9	851	+11	855	0
金布巴粉59.5%	834	+6	832	+5	829	+5	834	+8	833	+9	841	+11	840	0
罗伊山粉	864	+5	863	+4	873	+8	862	+6	873	+8	—	—	885	+5
IOC6	854	+5	864	+7	858	+8	880	+17	858	+8	864	+7	875	+5
FMG混合粉	817	+13	817	+13	830	+16	825	+6	825	+16	817	+13	818	0
超特粉	743	+5	742	+5	765	+20	759	+6	763	+18	—	—	775	0
杨迪粉	837	+8	839	+5	815	+16	814	+6	815	+16	827	+13	820	+9
卡拉拉精粉	998	+5	998	+5	—	—	1008	+9	—	—	—	—	990	+5
乌克兰精粉	1055	0	—	—	1020	+3	—	—	1020	+3	1020	+5	—	—
KUMBA	965	0	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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：823.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	70.5	69.5	69.5	70.5	69.5	76.5	86.5
卡拉加斯粉	151.5	151.5	163.5	166.5	166.5	151.5	181.5
巴混63.0%	98.5	98.5	99.5	110.5	99.5	96.5	121.5
巴混62.5%	93.5	93.5	89.5	100.5	89.5	91.5	116.5
纽曼粉	85.5	87.5	76.5	82.5	80.5	86.5	101.5
麦克粉	49.5	46.5	56.5	53.5	55.5	49.5	76.5
金布巴粉60.5%	20.5	18.5	15.5	20.5	19.5	27.5	31.5
金布巴粉59.5%	10.5	8.5	5.5	10.5	9.5	17.5	16.5
罗伊山粉	40.5	39.5	49.5	38.5	49.5	—	61.5
IOC6	30.5	40.5	34.5	56.5	34.5	40.5	51.5
FMG混合粉	-6.5	-6.5	6.5	1.5	1.5	-6.5	-5.5
超特粉	-80.5	-81.5	-58.5	-64.5	-60.5	—	-48.5
杨迪粉	13.5	15.5	-8.5	-9.5	-8.5	3.5	-3.5
卡拉拉精粉	174.5	174.5	—	184.5	—	—	166.5
乌克兰精粉	231.5	—	196.5	—	196.5	196.5	—
KUMBA	141.5	—	—	—	—	—	—

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

据工信部等七部门发布关于印发《钢铁行业稳增长工作方案》的通知，其中提到，落实扩大汽车、绿色智能家电消费以及绿色建材、新能源汽车下乡等促消费政策措施，挖掘风电、光伏发电等领域消费潜能，扩大钢材消费需求。开展铁矿石“红黄蓝”供需预警，强化期现货市场监管。

据中国钢铁工业协会数据显示，8月中旬，21个城市5大品种钢材社会库存963万吨，环比减少1万吨，下降0.1%，螺纹钢库存446万吨，环比减少4万吨，下降0.9%。

据Mysteel，由于不锈钢热轧材料的短缺，华南某不锈钢冷轧厂进行停产计划，预计停产时间在一周左右，影响201冷轧量级在1.5万吨左右，恢复生产时间仍未明确。

据钢银电商，本周城市总库存量为965.64万吨，较上周环比增加10.34万吨（+1.08%），包含39个城市，共计146个仓库。

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。