

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年09月01日08时27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	3740	27	0.73%	52	1.41%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3880	72	1.89%	-4	-0.10%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3740	20	0.54%	0	0
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3910	50	1.30%	20	0.51%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	0	-7		-52	
	热轧卷板主力基差	元/吨	30	-22		24	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-20	-7		6	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	51	-11		0	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	61	9		12	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	75	14		-8	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	-41	-2		-18	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-126	-3		8	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	120	38		1	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	106	33		21	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	191	34		-5		
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%	-10	-0.25%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4400	10	0.23%	-10	-0.23%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4750	20	0.42%	20	0.42%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3550	20	0.57%	0	0
	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	258.73	——		-4.72	-1.79%
	热卷产量	万吨	320.1	——		2.10	0.66%
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	1191.07	——		-7.42	-0.62%
	螺纹社会库存	万吨	581.6	——		-7.81	-1.33%
	热卷社会库存	万吨	289.18	——		-1.12	-0.39%
	五大品种钢厂库存	万吨	447.85	——		3.07	0.69%
	螺纹钢厂库存	万吨	195.88	——		-1.05	-0.53%
	热卷钢厂库存	万吨	86.15	——		-0.15	-0.17%
	唐山地区钢坯库存	万吨	67.61	——		5.69	9.19%
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	18.00	-3.71	-17.07%	-4.61	-20.38%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	15300	——		0	0
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	133027	300		8101	
	热卷注册仓单数量	吨	216784	-1489		-8981	
基本面概述	最近几日房地产方面的利好政策出台较多，对期价有一定的提振作用。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，表观需求有所回落，库存继续下降，市场逐渐并没有出现产销两旺的局面。目前市场是弱宏观与强政策、强需求预期之间的博弈，后市强需求预期不能兑现的概率较大						
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	889	18	2.07%	24	2.77%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	865	17	2.00%	27	3.22%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	849	20.0	2.41%	38.0	4.69%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	116.33	1.90	1.66%	5.65	5.10%
	普氏62%指数	美元/干吨	116.45	2.40	2.10%	-0.05	-0.04%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	40	-2.0		-14.0	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	16	-3.0		-11.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	80.5	16.5		6.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	42	5.0		5.0	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	100	-1	-0.99%	1	1.01%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	88	-3	-3.30%	3	3.53%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	66	-13	-16.46%	-8	-10.81%
	PB-超特粉（日照港）	元/吨	157	1	0.64%	0	0
	普氏65%-62%	美元/干吨	8.6	-2.40		-2.90	
	普氏62%-58%	美元/干吨	16.45	0.60		-0.30	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1598.8	—		-27.2	-1.67%
	巴西铁矿石发货量	万吨	825.5	—		100.3	13.83%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	7.56	-0.03	-0.40%	-0.10	-1.31%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	19.17	-0.08	-0.42%	-0.96	-4.77%
	美元指数		103.6415	0.4840	0.47%	-0.3061	-0.29%
	美元兑人民币即期		7.2595	-0.0295	-0.40%	-0.0195	-0.27%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1065.8	—		22.0	2.11%
	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	907.34	—		-18.41	-1.99%
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，铁矿石到港量环比有所上升，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，						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/9/1

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	915	+22	914	+21	916	+24	920	+25	917	+22	920	+20	930	+16
卡拉加斯粉	981	+9	980	+8	994	+21	993	+20	994	+22	984	+17	1010	+5
巴混63.0%	930	+22	929	+21	947	+22	960	+25	947	+22	935	+20	960	+11
巴混62.5%	925	+22	924	+21	937	+22	950	+25	937	+22	930	+20	955	+11
纽曼粉	926	+21	926	+23	925	+19	926	+19	925	+20	930	+20	945	+16
麦克粉	889	+18	888	+17	893	+15	894	+23	894	+16	890	+12	914	+16
金布巴粉60.5%	865	+17	867	+20	869	+20	867	+23	871	+23	867	+12	875	+16
金布巴粉59.5%	855	+17	857	+20	859	+20	857	+23	861	+23	857	+12	860	+16
罗伊山粉	885	+22	887	+21	897	+22	899	+25	897	+22	—	—	905	+16
IOC6	887	+22	879	+17	892	+22	881	+15	892	+22	879	+17	895	+16
FMG混合粉	835	+14	835	+15	845	+15	838	+10	835	+15	835	+15	855	+10
超特粉	758	+21	757	+20	765	+21	755	+10	760	+20	—	—	785	+15
杨迪粉	848	+15	849	+17	825	+15	840	+25	825	+15	845	+15	845	+18
卡拉拉精粉	1008	+10	1008	+10	—	—	1011	+20	—	—	—	—	995	+5
乌克兰精粉	1060	+10	—	—	1034	+22	—	—	1034	+22	1030	+10	—	—
KUMBA	970	+10	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

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：843.5

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	71.5	70.5	72.5	76.5	73.5	76.5	86.5
卡拉加斯粉	137.5	136.5	150.5	149.5	150.5	140.5	166.5
巴混63.0%	86.5	85.5	103.5	116.5	103.5	91.5	116.5
巴混62.5%	81.5	80.5	93.5	106.5	93.5	86.5	111.5
纽曼粉	82.5	82.5	81.5	82.5	81.5	86.5	101.5
麦克粉	45.5	44.5	49.5	50.5	50.5	46.5	70.5
金布巴粉60.5%	21.5	23.5	25.5	23.5	27.5	23.5	31.5
金布巴粉59.5%	11.5	13.5	15.5	13.5	17.5	13.5	16.5
罗伊山粉	41.5	43.5	53.5	55.5	53.5	—	61.5
IOC6	43.5	35.5	48.5	37.5	48.5	35.5	51.5
FMG混合粉	-8.5	-8.5	1.5	-5.5	-8.5	-8.5	11.5
超特粉	-85.5	-86.5	-78.5	-88.5	-83.5	—	-58.5
杨迪粉	4.5	5.5	-18.5	-3.5	-18.5	1.5	1.5
卡拉拉精粉	164.5	164.5	—	167.5	—	—	151.5
乌克兰精粉	216.5	—	190.5	—	190.5	186.5	—
KUMBA	126.5	—	—	—	—	—	—

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

中物联钢铁物流专业委员会公布数据显示，8月份钢铁行业PMI为45.2%，环比下降4.7个百分点，显示钢铁行业运行放缓。

Mysteel数据显示，截至8月31日当周，螺纹产量连续六周减少，厂库、社库连续第三周减少，表需由增转降。其中，螺纹产量258.73万吨，较上周减少4.72万吨，降幅为1.79%。

据Mysteel，河钢集团9月硅锰采量24000吨，8月硅锰采量23300吨，2022年9月采量19900吨。9月河钢75B硅铁招标数量2516吨，8月招标数量2600吨，较8月减少84吨。

据argus报道，截至8月26日当周，西澳大利亚的铁矿石出货量低于平均水平1%。根据最初的船运数据，皮尔巴拉地区的四家大型铁矿石生产商合计装载的船舶容量为1716万载重吨，低于截至8月19日当周的1808万载重吨。

隆众资讯数据显示，本周全国浮法玻璃日度平均产销率较上期提升7%，但整体仍处于90%以下，行业依旧处于累库状态。

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。