

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年09月12日08时41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	3759	42	1.13%	-54	-1.42%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3851	42	1.10%	-66	-1.68%
	螺纹钢现货价格（HRB400E 20mm，上海）	元/吨	3780	10	0.27%	-20	-0.53%
	热轧板卷现货价格（Q235 4.75mm，上海）	元/吨	3880	30	0.78%	-50	-1.27%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	21	-32		34	
	热轧卷板主力基差	元/吨	29	-12		16	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-47	-6		-4	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	55	-1		12	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	29	7		-26	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	56	0		-17	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	18	-1		30	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-111	1		5	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	92	0		-12	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	65	7		-21	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	194	5		4		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	3960	-10	-0.25%	10	0.25%
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4400	0	0	-40	-0.90%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4800	0	0	20	0.42%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3530	20	0.57%	-50	-1.40%
	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	——		0.73	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	246.92	——		1.35	0.55%
	盈利钢厂比例	%	45.02	——		-0.43	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	253.59	——		-5.14	-1.99%
	热卷产量	万吨	315.48	——		-4.62	-1.44%
独立电弧炉钢厂开工情况 （周度）	产能利用率	%	53.6	——		0.84	
	开工率	%	74.84	——		1.44	
	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	1182.49	——		-8.58	-0.72%
	螺纹社会库存	万吨	565.06	——		-16.54	-2.84%
	热卷社会库存	万吨	293.19	——		4.01	1.39%
	五大品种钢厂库存	万吨	433.95	——		-13.90	-3.10%
	螺纹钢厂库存	万吨	184.61	——		-11.27	-5.75%
	热卷钢厂库存	万吨	85.23	——		-0.92	-1.07%
	唐山地区钢坯库存	万吨	75.6	——		7.99	11.82%
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	18.69	-4.19	-18.31%	-5.47	-22.63%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	14200	——		-600	-4.05%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	161652	3288		21660	
	热卷注册仓单数量	吨	273546	-299		49949	
基本面概述	昨日公布的8月金融数据环比和同比改善较为明显，再叠加全国外汇市场自律机制专题会议的召开，市场风险偏好明显改善。MySteel公布的数据显示，上周螺纹产量回落，表观需求有所回落，库存继续下降，市场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	反弹后做空						

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	899	18	2.04%	6	0.67%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	874	15	1.75%	8	0.92%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	851.5	24.0	2.90%	7.0	0.83%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	117.35	4.02	3.55%	1.02	0.88%
	普氏62%指数	美元/干吨	116.8	-0.90	-0.76%	-1.40	-1.18%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	47.5	-6.0		-1.0	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	22.5	-9.0		1.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	78.5	3.0		3.5	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	37	0		-3.0	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	116	3	2.65%	13	12.62%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	97	0	0	7	7.78%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	70	-4	-5.41%	4	6.06%
	PB -超特粉（日照港）	元/吨	131	2	1.55%	-26	-16.56%
	普氏65%-62%	美元/干吨	8.6	0.00		0.65	
	普氏62%-58%	美元/干吨	15.6	-0.35		-1.75	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1612.8	——		-63.2	-3.77%
	巴西铁矿石发货量	万吨	609.7	——		-142.7	-18.97%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	8.28	0.35	4.41%	0.68	8.95%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	19.16	0.31	1.64%	0.38	2.02%
	美元指数		104.2774	0.6359	0.61%	0.0758	0.07%
	美元兑人民币即期		7.2675	0.0080	0.11%	-0.0190	-0.26%
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1242.5	——		241.7	24.15%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	312.41	——		0.81	0.26%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	11867.87	——		-258.89	-2.13%
	港口贸易库存	万吨	7299.45	——		-176.40	-2.36%
	进口矿烧结粉矿总库存：64家样本钢厂	万吨	966.2	——		58.86	6.49%
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	51.08	——		0.35	0.69%
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，但强政策的经济中推出极大的提振了市场的信心。供求方面，目前发货量环比小幅上升，海运费有所下降，铁矿石到港量环比有所上升，疏港量回落，港口库存有所上升，铁水产量有所上升，下游需求存在边际好转的预期。整体来看，供需整体仍偏紧，铁矿石的价格有望维持偏强的走势						
操作建议	维持观望，充分调整后可做多，追涨须谨慎						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/9/12

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	920	+22	920	+21	926	+16	930	+21	925	+19	925	+21	946	+18
卡拉加斯粉	990	+17	990	+17	1001	+16	1010	+20	1006	+23	996	+21	1015	+10
巴混63.0%	940	+23	940	+23	950	+19	970	+21	950	+19	945	+24	976	+18
巴混62.5%	935	+23	935	+23	940	+19	960	+21	940	+19	940	+24	971	+18
纽曼粉	936	+18	937	+19	944	+23	945	+21	943	+23	943	+25	956	+16
麦克粉	899	+18	900	+18	907	+21	909	+19	908	+27	906	+20	926	+18
金布巴粉60.5%	874	+15	875	+16	891	+20	899	+19	891	+22	875	+12	893	+9
金布巴粉59.5%	864	+15	865	+16	881	+20	889	+19	881	+22	865	+12	878	+9
罗伊山粉	890	+22	893	+21	905	+19	909	+21	905	+19	—	—	910	+22
IOC6	880	+13	879	+5	890	+19	890	+16	890	+19	879	+5	920	+18
FMG混合粉	867	+22	867	+19	873	+15	868	+19	864	+16	868	+20	893	+15
超特粉	787	+19	789	+19	778	+14	794	+19	775	+15	—	—	825	+15
杨迪粉	863	+10	863	+10	854	+16	865	+21	854	+16	872	+19	865	+15
卡拉拉精粉	1033	+20	1033	+20	—	—	1028	+20	—	—	—	—	1000	+10
乌克兰精粉	1065	+10	—	—	1058	+23	—	—	1058	+23	1055	+20	—	—
KUMBA	975	+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：856.0

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	64	64	70	74	69	69	90
卡拉加斯粉	134	134	145	154	150	140	159
巴混63.0%	84	84	94	114	94	89	120
巴混62.5%	79	79	84	104	84	84	115
纽曼粉	80	81	88	89	87	87	100
麦克粉	43	44	51	53	52	50	70
金布巴粉60.5%	18	19	35	43	35	19	37
金布巴粉59.5%	8	9	25	33	25	9	22
罗伊山粉	34	37	49	53	49	—	54
IOC6	24	23	34	34	34	23	64
FMG混合粉	11	11	17	12	8	12	37
超特粉	-69	-67	-78	-62	-81	—	-31
杨迪粉	7	7	-2	9	-2	16	9
卡拉拉精粉	177	177	—	172	—	—	144
乌克兰精粉	209	—	202	—	202	199	—
KUMBA	119	—	—	—	—	—	—

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

9月4日-9月11日本期Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2519.2万吨，环比减少243.7万吨。澳洲发运量1838.4万吨，环比减少48.5万吨，其中澳洲发往中国的量1520.3万吨，环比增加52.9万吨。巴西发运量680.8万吨，环比减少195.2万吨。

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。