

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年10月09日08时33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	3690	0	0	0	0
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3795	0	0	0	0
	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	3770	-20	-0.53%	-40	-1.05%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	100	0		0	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-25	-20		-40	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-75	0		-7	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	89	29		39	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	18	-4		-15	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	44	2		-6	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	57	4		22	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	-133	-31		-33	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	105	20		24	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	79	14		15	
	热卷10-螺纹10价差	元/吨	269	49		70	
中厚板线材冷轧价格	线材市场价（HPB300 6.5mm，上海）	元/吨	3980	0	0	0	0
	普碳中板市场价（8mm，上海）	元/吨	4310	-30	-0.69%	-30	-0.69%
	冷轧卷板市场价（1.0mm，上海）	元/吨	4880	0	0	0	0
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格（Q235）	元/吨	3470	20	0.58%	-10	-0.29%
	江阴废钢价格（6-8mm，现金不含税）	元/吨	2580	0	0	10	0.39%
钢厂高炉生产及盈利情况 （周度）	247家钢厂高炉开工率	%	84.17	——		-0.30	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	248.99	——		0.14	0.06%
	盈利钢厂比例	%	30.74	——		-3.46	
产量（周度）	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	254.25	——		-9.22	-3.50%
	热卷产量	万吨	320.03	——		4.31	1.37%
独立电弧炉钢厂开工情况 （周度）	产能利用率	%	53.04	——		-0.26	
	开工率	%	73.81	——		-1.76	
	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	1128.38	——		49.16	4.56%
	螺纹社会库存	万吨	501.4	——		22.52	4.70%
	热卷社会库存	万吨	304.25	——		13.56	4.66%
	五大品种钢厂库存	万吨	484.22	——		52.56	12.18%
	螺纹钢厂库存	万吨	207.26	——		32.80	18.80%
	热卷钢厂库存	万吨	94.8	——		6.31	7.13%
	唐山地区钢坯库存	万吨	104.52	——		14.93	16.66%
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	10.63	-0.50	-4.48%	-4.60	-30.23%
	线螺终端采购量（上海，周度）	吨	12600	——		0	0
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	126274	1520		4520	
	热卷注册仓单数量	吨	269102	0		0	
基本面概述	国庆长假期间，海外市场偏弱运行，国内地产市场改善不明显。MySteel公布的数据显示，上涨周螺纹产量小幅回落，表观需求大幅下降，且和往年相比仍有较大差距，库存大幅上升。目前市场是弱需求现实与宏观改善预期之间的博弈，当前期价走的应该是弱现实的逻辑。						
操作建议	空单可以继续持有						

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	920	-1	-0.11%	-5	-0.54%
	金布巴粉60.5%（青岛港）	元/湿吨	902	-1	-0.11%	-6	-0.66%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	852	0	0	0	0
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	114.84	-0.29	-0.25%	-1.71	-1.47%
	普氏62%指数	美元/干吨	119.45	-0.05	-0.04%	-0.35	-0.29%
基差及期货月间价差	麦克粉（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	68	-1.0		-5.0	
	金布巴粉60.5%（青岛港）-DCE铁矿石主力	元/吨	50	-1.0		-6.0	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	-108	0		0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	46.5	0		0	
	PB块粉价差（日照港）	元/湿吨	211	0	0	30	16.57%
	纽曼块粉价差（日照港）	元/湿吨	195	4	2.09%	31	18.90%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉（日照港）	元/吨	89	2	2.30%	5	5.95%
	PB -超特粉（日照港）	元/吨	90	1	1.12%	2	2.27%
	普氏65%-62%	美元/干吨	7.85	0		-0.00	
	普氏62%-58%	美元/干吨	12.8	-0.05		-0.35	
海外铁矿石发货量（周度）	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1705.3	——		240.6	16.43%
	巴西铁矿石发货量	万吨	924.7	——		191.1	26.05%
海运费与汇率	BCI运价：西澳-青岛	美元/吨	10.25	0.03	0.29%	0.99	10.69%
	BCI运价：图巴朗-青岛	美元/吨	24.06	0.08	0.33%	2.04	9.26%
	美元指数		106.1265	-0.2181	-0.21%	-0.0245	-0.02%
	美元兑人民币即期		7.2995	0	0	0	0
铁矿石到港量与疏港量（周度）	北方六港到货量合计	万吨	1160.1	——		89.2	8.33%
	日均疏港量（45港口合计）	万吨	343	——		3.87	1.14%
铁矿石库存（周度）	港口库存合计	万吨	11385.42	——		-207.19	-1.79%
	港口贸易矿库存	万吨	6846.69	——		-147.86	-2.11%
	进口矿烧结粉矿总库存：64家样本钢厂	万吨	994.54	——		-335.25	-25.21%
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	49.98	——		-1.56	-3.03%
期货仓单	数量	张	0	0		-2200	
基本面概述	供求方面，目前发货量环比小幅上升，海运费有所上升，铁矿石到港量环比上升，疏港量小幅上涨，港口库存继续下降，铁水产量维持高位，下游需求表现较好。整体来看，供需整体仍偏紧，即使螺纹出现下跌，铁矿石的价格有望维持相对偏强的走势，短期维持高位震荡的概率极大						
操作建议	维持观望						

铁矿石粉矿现货品牌价格（元/湿吨）

2023/10/9

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	935	+3	935	+1	955	0	965	0	960	0	938	-2	970	0
卡拉加斯粉	1019	0	1024	+3	1033	+2	1035	+14	1030	0	1025	+3	1050	0
巴混63.0%	960	+3	961	+1	985	0	1005	0	985	0	958	-2	1000	0
巴混62.5%	955	+3	956	+1	975	0	995	0	975	0	953	-2	995	0
纽曼粉	951	0	951	-3	973	0	985	0	973	0	952	-2	980	0
麦克粉	920	-1	920	-5	941	0	950	0	941	-2	924	-1	960	0
金布巴粉60.5%	902	-1	902	-1	920	0	920	0	920	0	902	-1	930	-2
金布巴粉59.5%	892	-1	892	-1	910	0	910	0	910	0	892	-1	915	-2
罗伊山粉	905	+3	908	+1	940	0	946	0	940	0	—	—	938	0
IOC6	906	-3	906	-3	925	0	912	0	925	0	906	-3	947	0
FMG混合粉	895	0	895	-1	900	0	900	+2	900	0	895	0	930	-1
超特粉	845	0	845	0	845	0	848	+2	845	0	—	—	884	0
杨迪粉	900	0	901	+1	890	0	900	0	890	0	895	-1	905	0
卡拉拉精粉	1088	0	1093	0	—	—	1053	+14	—	—	—	—	1100	0
乌克兰精粉	1095	-5	—	—	1082	0	—	—	1082	0	1115	0	—	—
KUMBA	1005	-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：852.0

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	83	83	103	113	108	86	118
卡拉加斯粉	167	172	181	183	178	173	198
巴混63.0%	108	109	133	153	133	106	148
巴混62.5%	103	104	123	143	123	101	143
纽曼粉	99	99	121	133	121	100	128
麦克粉	68	68	89	98	89	72	108
金布巴粉60.5%	50	50	68	68	68	50	78
金布巴粉59.5%	40	40	58	58	58	40	63
罗伊山粉	53	56	88	94	88	—	86
IOC6	54	54	73	60	73	54	95
FMG混合粉	43	43	48	48	48	43	78
超特粉	-7	-7	-7	-4	-7	—	32
杨迪粉	48	49	38	48	38	43	53
卡拉拉精粉	236	241	—	201	—	—	248
乌克兰精粉	243	—	230	—	230	263	—
KUMBA	153	—	—	—	—	—	—

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

从Mysteel公布的周度螺纹钢库存数据发现，本周螺纹钢总库存为708.66万吨，上周为653.34万吨，本周累库55.32万吨，上周去库37.08万吨。近三年同期表现为：2022年去库59.07万吨，2021年去库102.13万吨，2020年去库83.26万吨。此外，本周表需205.85万吨，上周为300.55万吨，近三年同期水平为：2022年为258.9万吨，2021年为350.4万吨，2020年为457.67万吨。

【沙钢集团：8位股东集体离场信息纯属无中生有】据江苏沙钢集团官微消息，近期，相关媒体发布我司8位股东集体离场的不实信息，给我司声誉造成了严重影响，我司在此郑重声明：相关媒体发布的8位股东集体离场信息纯属无中生有，我司要求相关媒体立即删除此错误信息。如因发布上述错误信息造成我司商誉损失的，我司将保留追究相关媒体侵权权利的权利。

Mysteel统计全国45个港口进口铁矿石库存为11181.06万吨，环比降204.36万吨。47港进口铁矿石库存总量11857.06万吨，环比降166.36万吨。

截止2023年10月2日，Mysteel调研统计，2023年已淘汰焦化产能2050万吨，新增2647.5万吨，净新增597.5万吨；预计2023年淘汰焦化产能5228万吨，新增5020万吨，净淘汰208万吨。

9月份钢铁行业PMI为45.8%，环比上升0.6个百分点，显示钢铁行业虽低位有所趋稳，但仍处于偏紧格局，旺季成色有所不足。分项指数变化显示，市场需求略有改善，但程度有限；钢企生产整体继续下滑，供需两端整体偏紧运行。

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。