

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年10月19日08时34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	3615	-32	-0.88%	-4	-0.11%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	3747	-19	-0.50%	29	0.78%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	3740	-10	-0.27%	30	0.81%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	3760	-20	-0.53%	30	0.80%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	125	22		34	
	热轧卷板主力基差	元/吨	13	-1		1	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	-13	3		84	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	-70	-1		-118	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	-18	-9		-37	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	29	0		-10	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	31	6		-47	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	41	1		128	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	132	13		33	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	85	4		6	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	75	9		-169		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	3950	10	0.25%	40	1.02%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4270	-20	-0.47%	0	0
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4810	-10	-0.21%	-50	-1.03%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3410	-20	-0.58%	-10	-0.29%
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2510	0	0	-20	-0.79%
钢厂高炉生产及盈利情况 (周度)	247家钢厂高炉开工率	%	83.41	——		-0.76	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	247.01	——		-1.98	-0.80%
	盈利钢厂比例	%	24.24	——		-6.50	
产量 (周度)	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	252.79	——		-1.46	-0.57%
	热卷产量	万吨	316.93	——		-3.10	-0.97%
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	产能利用率	%	49.42	——		1.16	
	开工率	%	68.01	——		1.96	
	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	1114.95	——		-13.43	-1.19%
	螺纹社会库存	万吨	483.54	——		-17.86	-3.56%
	热卷社会库存	万吨	305.61	——		1.36	0.45%
	五大品种钢厂库存	万吨	488.52	——		4.30	0.89%
	螺纹钢厂库存	万吨	209.25	——		1.99	0.96%
	热卷钢厂库存	万吨	94.7	——		-0.10	-0.11%
	唐山地区钢坯库存	万吨	114.28	——		9.76	9.34%
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	22.24	-0.96	-4.13%	1.69	8.24%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	19200	——		6600	52.38%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	135899	-4196		-14187	
	热卷注册仓单数量	吨	290419	-11999		-12614	
基本面概述	MySteel公布的数据显示, 上周螺纹产量小幅回落, 表观需求有所反弹, 但和往年相比仍有较大差距, 库存小幅下降。最新公布的9月宏观经济运行数据显示, 目前房地产市场仍处于筑底阶段, 对钢材的终端需求有一定的拖累。巴以冲突的扩大以及股市的下跌可能压制市场的风险偏好						
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	930	6	0.65%	34	3.79%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	904	1	0.11%	29	3.31%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	861	-5.0	-0.58%	33.5	4.05%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	117.5	0.34	0.29%	2.66	2.32%
	普氏62%指数	美元/干吨	120.35	0.20	0.17%	6.30	5.52%
基差及期货月间价差	麦克粉 (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	69	11.0		0.5	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	43	6.0		-4.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	-121.5	-3.5		-11.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	59	3.0		7.0	
	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	202	-8	-3.81%	-18	-8.18%
	纽曼块粉价差 (日照港)	元/湿吨	176	-9	-4.86%	-21	-10.66%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉 (日照港)	元/吨	85	0	0	-4	-4.49%
	PB-超特粉 (日照港)	元/吨	104	0	0	14	15.56%
	普氏65%-62%	美元/干吨	8.8	-0.20		0.80	
	普氏62%-58%	美元/干吨	13.05	0.20		2.55	
海外铁矿石发货量 (周度)	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1632.9	—		-44.0	-2.62%
	巴西铁矿石发货量	万吨	681.2	—		178.2	35.43%
海运费与汇率	BCI运价: 西澳-青岛	美元/吨	10.69	0.21	2.00%	-0.47	-4.21%
	BCI运价: 图巴朗-青岛	美元/吨	25.85	0.29	1.13%	-0.58	-2.19%
	美元指数		106.5526	0.3497	0.33%	0.8366	0.79%
	美元兑人民币即期		7.3151	-0.0009	-0.01%	0.0161	0.22%
铁矿石到港量与疏港量 (周度)	北方六港到货量合计	万吨	1158.7	—		223.5	23.90%
	日均疏港量 (45港口合计)	万吨	323.09	—		-19.91	-5.80%
铁矿石库存 (周度)	港口库存合计	万吨	10845.6	—		-539.82	-4.74%
	港口贸易矿库存	万吨	6401.86	—		-444.83	-6.50%
	进口矿烧结粉矿总库存: 64家样本钢厂	万吨	990.06	—		-4.48	-0.45%
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	2100	0		0	
基本面概述	供求方面, 目前发货量环比小幅回落, 海运费有所上升, 铁矿石到港量环比下降, 疏港量小幅回落, 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, 但随着钢厂亏损扩大之后减产增加, 铁矿石也可能将展开深度调整						
操作建议	维持观望						

铁矿石粉矿现货品牌价格 (元/湿吨)

2023/10/19

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	929	-9	929	-9	950	-9	964	-6	953	-5	932	-10	957	-8
卡拉加斯粉	1014	-11	1013	-10	1015	-10	1028	-2	1012	-13	1013	-16	1050	-13
巴混63.0%	949	-9	950	-8	978	-5	999	-6	978	-5	957	-5	980	-15
巴混62.5%	944	-9	944	-9	968	-5	989	-6	968	-5	952	-5	975	-15
纽曼粉	946	-9	945	-9	965	-6	984	-6	970	-1	946	-10	972	-8
麦克粉	919	-11	920	-10	931	-4	950	-2	932	-3	919	-10	947	-8
金布巴粉60.5%	895	-9	897	-8	918	-2	925	-7	925	+1	901	-7	925	-8
金布巴粉59.5%	885	-9	887	-8	908	-2	915	-7	915	+1	891	-7	910	-8
罗伊山粉	899	-12	902	-9	933	-5	938	-6	933	-5	—	—	928	-8
IOC6	891	-10	891	-9	923	-5	919	-6	923	-5	893	-7	932	-8
FMG混合粉	869	-9	870	-8	877	-3	875	-10	877	-3	870	-8	910	0
超特粉	825	-10	825	-9	841	-5	842	-10	828	-12	—	—	865	0
杨迪粉	900	-5	900	-5	867	-3	911	-6	867	-3	900	-5	887	-8
卡拉拉精粉	1098	-3	1098	-3	—	—	1046	-2	—	—	—	—	1102	-13
乌克兰精粉	1115	+5	—	—	1064	-13	—	—	1064	-13	1120	-3	—	—
KUMBA	1010	+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: **860.0**

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	69	69	90	104	93	72	97
卡拉加斯粉	154	153	155	168	152	153	190
巴混63.0%	89	90	118	139	118	97	120
巴混62.5%	84	84	108	129	108	92	115
纽曼粉	86	85	105	124	110	86	112
麦克粉	59	60	71	90	72	59	87
金布巴粉60.5%	35	37	58	65	65	41	65
金布巴粉59.5%	25	27	48	55	55	31	50
罗伊山粉	39	42	73	78	73	—	68
IOC6	31	31	63	59	63	33	72
FMG混合粉	9	10	17	15	17	10	50
超特粉	-35	-35	-19	-18	-32	—	5
杨迪粉	40	40	7	51	7	40	27
卡拉拉精粉	238	238	—	186	—	—	242
乌克兰精粉	255	—	204	—	204	260	—
KUMBA	150	—	—	—	—	—	—

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

中钢协发布数据显示，10月上旬，21个城市5大品种钢材社会库存为924万吨，环比增加3.1%，库存由降转升；比年初增加22.9%，同比增加2.3%。

截至10月18日当周，找钢网库存分析：建材产量333.69万吨，周环比增2.29万吨，升0.69%；年同比减58.24万吨，降14.86%。建材厂库310.92万吨，周环比增3.84万吨，升1.25%；年同比减7.22万吨，降2.27%。建材社库469.18万吨，周环比减38.04万吨，降7.50%；年同比增65.22万吨，升16.15%。建材表需367.89万吨，周环比增47.77万吨。

【钢铁企业生产释放力度呈现逐渐下降的态势】从目前高炉开工率变化来看，钢铁企业生产释放力度呈现逐渐下降的态势。据兰格钢铁网调研数据显示，2023年10月份前两周全国百家中小钢企高炉开工率的均值为78.9%，较9月份下降0.6个百分点；全国201家生产企业铁水日均产量为228.1万吨，较上月同期减少1.3万吨，较9月全月均值减少1.1万吨，从8月中下旬以来，呈现连续7周的下滑态势。

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。