

山金期货黑色板块日报

更新时间：2023年11月28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	3959	-17	-0.43%	-24	-0.60%
	热轧卷板主力合约收盘价	元/吨	4055	1	0.02%	8	0.20%
	螺纹钢现货价格 (HRB400E 20mm, 上海)	元/吨	4060	0	0	-20	-0.49%
	热轧板卷现货价格 (Q235 4.75mm, 上海)	元/吨	4000	10	0.25%	10	0.25%
基差与价差	螺纹钢主力基差	元/吨	101	17		4	
	热轧卷板主力基差	元/吨	-55	9		2	
	螺纹钢期货10-1价差	元/吨	11	23		67	
	热轧卷板期货10-1价差	元/吨	-44	11		25	
	螺纹钢期货1-5价差	元/吨	-28	-14		-34	
	热轧卷板期货1-5价差	元/吨	10	-1		-9	
	螺纹钢期货5-10价差	元/吨	17	-9		-33	
	热轧卷板期货5-10价差	元/吨	34	-10		-16	
	热卷01-螺纹01价差	元/吨	96	18		32	
	热卷05-螺纹05价差	元/吨	58	5		7	
热卷10-螺纹10价差	元/吨	41	6		-10		
中厚板线材冷轧价格	线材市场价 (HPB300 6.5mm, 上海)	元/吨	4290	0	0	-10	-0.23%
	普碳中板市场价 (8mm, 上海)	元/吨	4490	20	0.45%	0	0
	冷轧卷板市场价 (1.0mm, 上海)	元/吨	4810	0	0	20	0.42%
钢坯及废钢价格	唐山钢坯价格 (Q235)	元/吨	3650	0	0	-30	-0.82%
	江阴废钢价格 (6-8mm, 现金不含税)	元/吨	2550	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	%	79.67	—		-1.34	
	247家钢厂日均铁水量	万吨	235.47	—		-3.25	-1.36%
	盈利钢厂比例	%	39.39	—		10.39	
产量 (周度)	全国建材钢厂螺纹钢产量	万吨	254.84	—		-0.02	-0.01%
	热卷产量	万吨	319.91	—		11.47	3.72%
独立电弧炉钢厂开工情况 (周度)	产能利用率	%	63.44	—		4.23	
	开工率	%	74.22	—		1.03	
	电炉钢厂螺纹钢产量	万吨	82.56	—		35.11	73.99%
库存 (周度)	五大品种社会库存	万吨	897.17	—		-25.87	-2.80%
	螺纹社会库存	万吨	358.24	—		-10.64	-2.88%
	热卷社会库存	万吨	256.47	—		-8.59	-3.24%
	五大品种钢厂库存	万吨	412.81	—		-1.01	-0.24%
	螺纹钢厂库存	万吨	161.59	—		-1.41	-0.87%
	热卷钢厂库存	万吨	88.78	—		1.61	1.85%
	唐山地区钢坯库存	万吨	127.72	—		6.45	5.32%
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	17.60	-3.96	-18.37%	-4.04	-18.66%
	线螺终端采购量 (上海, 周度)	吨	16800	—		-100	-0.59%
期货仓单	螺纹注册仓单数量	吨	15270	0		0	
	热卷注册仓单数量	吨	304053	0		-1222	
基本面概述	目前市场各种消息和传闻较多, 对行情扰动加大。前期市场关注的焦点是房地产支持政策的推出情况, 价格大幅上涨应已经充分反应了这方面的利多。MySteel公布的数据显示, 上涨周螺纹产量小幅回落, 表观需求继续下滑, 去库延续。从技术面看, 期价跌穿下方10日均线的支撑, 如果不能很快企稳, 则后市可能将转为震荡。						
操作建议	充分调整后可短线做多, 追涨杀跌须谨慎						

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	979	-7	-0.71%	4	0.41%
	金布巴粉60.5% (青岛港)	元/湿吨	960	-5	-0.52%	5	0.52%
	DCE铁矿石主力合约结算价	元/干吨	980.5	-6.0	-0.61%	12.5	1.29%
	SGX铁矿石连一结算价	美元/干吨	133.86	0.68	0.51%	3.82	2.94%
	普氏62%指数	美元/干吨	133.45	-2.15	-1.59%	1.55	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	-1.5	-1.0		-8.5	
	金布巴粉60.5% (青岛港) -DCE铁矿石主力	元/吨	-20.5	1.0		-7.5	
	DCE铁矿石期货9-1价差	元/干吨	-100.5	-1.5		8.0	
	DCE铁矿石期货1-5价差	元/干吨	39	0.5		-7.0	
PB块粉价差 (日照港)	PB块粉价差 (日照港)	元/湿吨	165	-7	-4.07%	1	0.61%
	纽曼块粉价差 (日照港)	元/湿吨	145	-6	-3.97%	1	0.69%

品种价差	卡拉加斯粉-PB粉 (日照港)	元/吨	95	-1	-1.04%	-4	-4.04%
	PB-超特粉 (日照港)	元/吨	123	-3	-2.38%	-12	-8.89%
	普氏65%-62%	美元/干吨	14.65	2.15		2.55	
	普氏62%-58%	美元/干吨	12.65	-2.15		-0.75	
海外铁矿石发货量 (周度)	澳大利亚铁矿石发货量	万吨	1628.4	——		-157.7	-8.83%
	巴西铁矿石发货量	万吨	687.4	——		-1.5	-0.22%
海运费与汇率	BCI运价: 西澳-青岛	美元/吨	10.08	0.59	6.22%	-0.44	-4.18%
	BCI运价: 图巴朗-青岛	美元/吨	24.1	2.15	9.79%	1.60	7.11%
	美元指数		103.2163	-0.2220	-0.21%	-0.2729	-0.26%
	美元兑人民币即期		7.1528	0.0040	0.06%	-0.0127	-0.18%
铁矿石到港量与疏港量 (周度)	北方六港到货量合计	万吨	1488.7	——		179.7	13.73%
	日均疏港量 (45港口合计)	万吨	301.54	——		-0.90	-0.30%
铁矿石库存 (周度)	港口库存合计	万吨	11309.1	——		82.20	0.73%
	港口贸易矿库存	万吨	6693.28	——		35.38	0.53%
	进口矿烧结粉总库存: 64家样本钢厂	万吨	1091.58	——		63.61	6.19%
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	50.65	——		0.58	1.16%
期货仓单	数量	张	2200	0		400	
基本面概述	近日, 国家发展改革委价格司会同交通运输部水运局、市场监管总局价监竞争局组织主要港口企业召开会议, 了解港口铁矿石库存、堆存装卸收费等有关情况, 研究加强港口铁矿石监管, 强化行业自律, 合理设置库场使用相关规则, 加快货物周转, 坚决防范利用廉价场地囤积居奇和投机炒作, 切实维护市场秩序。技术面上, 期价走低, kdj指标现超买迹象, 上行空间或有限, 预计短期期价仍维持高位震荡格局。						
操作建议	短线多单建议逢高离场, 不可追涨杀跌, 稳健者维持观望						

铁矿石粉矿现货品牌价格 (元/湿吨)

2023/11/28

	青岛港		日照港		京唐港		天津港		曹妃甸港		连云港		江阴港	
PB粉	995	-3	995	-3	1006	-4	1005	-6	1002	-6	997	-4	1025	-2
卡拉加斯粉	1091	-3	1090	-4	1100	-3	1113	+2	1103	-2	1090	-5	1125	0
巴混63.0%	1020	-2	1021	-1	1022	-6	1055	-1	1022	-6	1017	-4	1045	0
巴混62.5%	1015	-2	1014	-3	1017	-6	1045	-1	1017	-6	1012	-4	1040	-2
纽曼粉	1005	-4	1007	-2	1013	-6	1020	-6	1013	-6	1007	-4	1035	-2
麦克粉	979	-7	979	-6	984	-5	995	-3	982	-8	982	-3	1015	-2
金布巴粉60.5%	960	-5	960	-3	969	-9	975	-4	972	-9	960	-6	985	0
金布巴粉59.5%	950	-5	950	-3	959	-9	965	-4	962	-9	950	-6	970	0
罗伊山粉	965	-3	968	-3	977	-6	970	0	977	-6	——	——	1006	-2
IOC6	968	-3	970	-3	967	-6	986	-6	967	-6	970	-5	1000	-2
FMG混合粉	916	-4	920	0	938	+5	940	+5	938	+4	920	-1	936	+3
超特粉	868	-5	872	0	889	-3	878	-2	885	+1	——	——	891	-2
杨迪粉	954	0	950	-3	938	+4	938	-6	938	+4	950	-3	970	-2
卡拉拉精粉	1151	0	1151	0	——	——	1131	+2	——	——	——	——	1175	0
乌克兰精粉	1170	-5	——	——	1160	-2	——	——	1160	-2	1173	0	——	——
KUMBA	1055	-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: **970.5**

	青岛港	日照港	京唐港	天津港	曹妃甸港	连云港	江阴港
PB粉	24.5	24.5	35.5	34.5	31.5	26.5	54.5
卡拉加斯粉	120.5	119.5	129.5	142.5	132.5	119.5	154.5
巴混63.0%	49.5	50.5	51.5	84.5	51.5	46.5	74.5
巴混62.5%	44.5	43.5	46.5	74.5	46.5	41.5	69.5
纽曼粉	34.5	36.5	42.5	49.5	42.5	36.5	64.5
麦克粉	8.5	8.5	13.5	24.5	11.5	11.5	44.5
金布巴粉60.5%	-10.5	-10.5	-1.5	4.5	1.5	-10.5	14.5
金布巴粉59.5%	-20.5	-20.5	-11.5	-5.5	-8.5	-20.5	-0.5
罗伊山粉	-5.5	-2.5	6.5	-0.5	6.5	——	35.5
IOC6	-2.5	-0.5	-3.5	15.5	-3.5	-0.5	29.5
FMG混合粉	-54.5	-50.5	-32.5	-30.5	-32.5	-50.5	-34.5
超特粉	-102.5	-98.5	-81.5	-92.5	-85.5	——	-79.5
杨迪粉	-16.5	-20.5	-32.5	-32.5	-32.5	-20.5	-0.5
卡拉拉精粉	180.5	180.5	——	160.5	——	——	204.5
乌克兰精粉	199.5	——	189.5	——	189.5	202.5	——
KUMBA	84.5	——	——	——	——	——	——

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

中国钢铁工业协会副会长骆铁军在2023钢铁产业链安全保障大会上表示，为提升钢铁行业资源保障能力，钢协研究提出了“基石计划”建议，目前，国内重点铁矿项目中已开工十多项，新增铁精矿产能约5000万吨。近期，协会就废钢相关问题向有关部委司局进行了汇报，废钢协调机制也正在研究制订中。

吕梁市政府生态环境安全专班召开全市生态环境安全隐患排查整治推进会议，会议强调，全市负责生态环境安全的各级各部门要深刻汲取近期发生的“11.16”永聚煤业重大火灾事故沉痛教训，立即启动为期三个月的生态环境领域“大排查、大整治、大提升”专项行动。

高盛在一份报告中说，从目前来看，到2024年，铁矿石市场将趋于平衡，而此前的预期是供应过剩，这表明目前并不存在供应过剩的风险。高盛目前预计铁矿石3个月目标价为每吨130美元，6个月目标价为每吨120美元。

据Mysteel，国家统计局数据显示，2023年10月山东粗钢产量619.57万吨，同比下降75万吨，降幅10.75%。从产量来看，已经连续2月处于“均值”以下，降幅超出市场预期；按照目前的生产节奏，未来两月同比降幅将超100万吨，全年粗钢产量有望和去年持平，继续实现山东省粗钢7600万吨的目标任务。

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。