瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

# 热轧卷板产业链日报

2024/1/3

| 项目类别 | 数据指标 | 最新 | 环比 | 数据指标 | 最新 | 环比 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 期货市场 | HC 主力合约收盘价(元/吨) | 4,160.00 | +14.00↑ | HC 主力合约持仓量(手) | 1051031 | +29380↑ |
| | HC 合约前20名净持仓(手) | -17,377.00 | -9637↓ | HC1-5合约价差(元/吨) | -10 | +6↑ |
| | HC 上期所仓单日报(日，吨) | 369165 | -1196.00↓ | HC2405-RB2405合约价差(元/吨) | 105 | +6.00↑ |
| 现货市场 | 上海 4.75热轧板卷(元/吨) | 4,110.00 | +20.00↑ | 广州 4.75热轧板卷(元/吨) | 4,220.00 | +20.00↑ |
| | 武汉 4.75热轧板卷(元/吨) | 4,140.00 | +20.00↑ | 天津 4.75热轧板卷(元/吨) | 4,010.00 | +20.00↑ |
| | HC主力合约基差(元/吨) | -50.00 | +6.00↑ | 上海热卷-螺纹钢价差(元/吨) | 100.00 | +10.00↑ |
| 上游情况 | 青岛港61.5%PB粉矿 (元/湿吨) | 1,062.00 | +27.00↑ | 河北准一级冶金焦（市场价；元/吨） | 2,550.00 | 0.00 |
| | 江苏6-10mm废钢（不含税，元/吨 | 2,809.00 | +23.00↑ | 河北Q235方坯（元/吨） | 3,710.00 | +60.00↑ |
| | 国内铁矿石港口库存(周，万吨) | 11,988.61 | +99.01↑ | 样本焦化厂焦炭库存（周，万吨） | 54.01 | -12.92↓ |
| | 样本钢厂焦炭库存量(周，万吨) | 611.17 | +33.14↑ | 河北钢坯库存量(周，万吨) | 86.88 | -4.10↓ |
| 产业情况 | 247家钢厂高炉开工率(周，%) | 75.17 | -2.52↓ | 247家钢厂高炉产能用率(周，%) | 82.73 | -2.00↓ |
| | 样本钢厂热卷产量(周，万吨) | 316.98 | +0.09↑ | 样本钢厂热卷产能利用率（周，%） | 80.97 | +0.02↑ |
| | 样本钢厂热卷厂库(周，万吨) | 85.23 | -4.70↓ | 33城热卷社会库存(周，万吨) | 219.75 | -4.58↓ |
| | 国内粗钢产量(月，万吨) | 7,610 | -299↓ | 钢材净出口量(月，万吨) | 740.00 | +13.00↑ |
| 下游情况 | 汽车产量(月，万辆) | 309.32 | +20.19↑ | 汽车销量(月，万辆) | 297.01 | +11.76↑ |
| | 空调(月，万台) | 1,595.70 | +222.70↑ | 家用电冰箱(月，万台) | 828.60 | +1.40↑ |
| | 家用洗衣机(月，万台) | 1,025.30 | +19.60↑ | | | |

**行业消息**

1、◎国务院国资委召开中央企业财务工作会议。会议指出，2024年各中央企业要深挖价值创造潜力，以提质增效为主线，聚力实现经营效益稳步增长；顺应智能变革趋势，以司库建设为抓手，加快推进财务数智化转型。

2、据国际船舶网，2023年12月25日-31日，全球船厂共接获50艘新船订单。其中，中国船厂获得44艘新船订单；日本船厂获得2艘新船订单；韩国船厂获得2艘新船订单；挪威和葡萄牙船厂也获得相关新船订单。

更多资讯请关注！

**观点总结**

周三HC2405合约震荡偏强，现货市场报价上调。本期热卷周度产量相对平稳，库存量则继续下滑，周度表观消费量小幅提升。部分终端下游根据订单情况按需补库，传统淡季和天气影响下游需求进度，但热卷终端需求还是好于市场预期，库存下滑对热卷期价构成支撑。技术上，HC2405 合约1小时 MACD指标显示 DIFF与 DEA向上反弹。操作上建议，震荡偏多交易，注意风险控制。

**重点关注**

周四热卷周度产量、厂内库存及社会库存

数据来源第三方，观点仅供参考。市场有风险，投资需谨慎！

备注：HC：热轧卷板


研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101

助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823 王凯慧 期货从业资格号F03100511

王世霖 期货从业资格号F03118150



免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，瑞达期货股份有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。