信达期货 CINDA FUTURES

钢矿早报 2020-5-13

联系人：陈敏华
执业咨询号：Z0012670
电话：0571-28132639
chenminhua@cindasc.com

联系人：金成
执业编号：F3061509
电话：0571-28132639
jincheng@cindasc.com

联系人：李涛
执业编号：F3064172
电话：0571-28132639
litao@cindasc.com

品种	指标	频率	前值	现值	涨跌	涨跌幅	历史区间
螺纹钢	现货价格（折算）：上海（元/吨）	日	3629	3629	0	0.00%	
	现货价格（折算）：天津（元/吨）	日	3698	3698	0	0.00%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3140	3140	0	0.00%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	-177	-165	12	6.78%	（-1220,205）
	即期利润：河北（元/吨）	日	430	435	5	1.21%	（-300，1820）
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	-87	-97	-10	11.47%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-244	-294	-51	-20.76%	
	全国钢厂盈利面（%）	周	76.07	78.08	2.01	2.64%	（3.07，92.59）
	全国高炉开工率（%）	周	69.06	69.75	0.69	1.00%	（61.88，96.8）
	重点钢企粗钢日均产量（万吨）	旬	195.15	201.20	6.05	3.10%	（140， 200.57）
	重点钢企钢材库存（万吨）	旬	1742.03	1472.82	-269.21	-15.45%	（1134.1， 1746）
	螺纹社会库存（万吨）	周	995.67	949.22	-46.45	-4.67%	（288.9， 970）
	沪终端线螺采购量（吨）	周	30300	32200	1900	6.27%	（2000， 50000）
	仓单(吨)	日	24611	24611	0	0.00	(0， 92176)
	建材每日成交量	日	23.7	22.36	-1.34	-5.65%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	730.3	727.1	-3.3	-0.45%	
	期现价差（元/吨）	日	-100.33	-89.07	11.3	11.22%	(-164.52， 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	87.85	90.15	2.30	2.62%	(40， 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.6526	0.6477	-0.0049	-0.75%	（0.687，1.103）
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	3.94	3.73	-0.21	-5.43%	（2.84，50.85）
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	8.15	7.79	-0.36	-4.42%	（5.35，108.75）
	澳洲铁矿发运量（至中国，万吨）	周	1526.90	1324.00	-202.90	-13.29%	（307.8，1565.4）
	巴西铁矿发运量（万吨）	周	526.60	461.8	-65	-12.31%	（342.7，1047.13）
	北方六港到货量（万吨）	周	1000.00	1099	99	9.90%	（686.7， 1516.5）
	港口库存（万吨）	周	11398	11188.96	-209	-1.83%	(6654， 16281.8)
	日均疏港量（万吨）	周	318.43	316.44	-2.0	-0.62%	（178.8，307.89）
	大中钢厂库存可用天数（天）	周	26.0	27.0	1.0	3.85%	(19， 37)
	港口铁矿石累计成交量	日	115.0	171.2	56.2	48.87%	
铁矿石期权	i2005-C-650 隐含波动率	日	19.92%	20.58%	0.66%		
	i2005-P-650 隐含波动率	日	23.25%	23.33%	0.08%		
	90天历史波动率	日	40.62%	39.84%	-0.77%		

螺纹钢	策略：多单继续持有，关注阶段性冲顶信号。技术面：站稳3400上方,小幅振荡。基本面：螺纹钢表观需求443万吨，铁水从热卷向螺纹转移，长流程螺纹产量明显加快，建材成交量中高位，长流程利润中性。废钢价格回升，短流程钢厂处于盈亏附近，部分开始单班生产，短流程产量回升至历史同期水平，企稳走平。
铁矿石	策略：多单继续持有，关注阶段性冲顶信号。技术面：多头趋势明显，小幅振荡。基本面：供经过3/4月份高发货量周，海外铁矿石库存拐点向下，预计5月份发货量难以达到4月份水平，但5月份港口到货量应该和4月份相差不大，在日均疏港量持续高位的情况下，预计5月份港口库存仍将偏低运行。
铁矿石期权	无

报告中的信息均来源于公开可获得的资料，信达期货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。未经信达期货有限公司授权许可，任何引用、转载以及向第三方传播本报告的行为均可能承担法律责任。