



信达期货
CINDA FUTURES

钢矿早报 2020-5-18

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	3639	10	0.28%	
	现货价格(折算): 天津(元/吨)	日	3698	3709	10	0.28%	
	现货价格: 唐山方坯(元/吨)(早)	日	3160	3170	10	0.32%	
	期现价差: 上海(元/吨)	日	-184	-175	9	4.73%	(-1220, 205)
	即期利润: 河北(元/吨)	日	414	424	10	2.41%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润: 华东(元/吨)	日	-186	-186	0	0.00%	
	电炉螺纹钢利润: 华北(元/吨)	日	-294	-294	0	0.00%	
	全国钢厂盈利面(%)	周	78.08	76.69	-1.39	-1.78%	(3.07, 92.59)
	全国高炉开工率(%)	周	69.75	70.44	0.69	0.99%	(61.88, 96.8)
	重点钢企粗钢日均产量(万吨)	旬	201.20	205.17	3.97	1.97%	(140, 200.57)
	重点钢企钢材库存(万吨)	旬	1472.82	1466.18	-6.64	-0.45%	(1134.1, 1746)
	螺纹社会库存(万吨)	周	949.22	893.2	-56.02	-5.90%	(288.9, 970)
	沪终端线螺采购量(吨)	周	30600	33400	2800	9.15%	(2000, 50000)
	仓单(吨)	日	21359	20469	-890	-0.04	(0, 92176)
		建材每日成交量	日	22.49	28.64	6.15	27.35%
铁矿石	价格(折算): 61.5%PB粉(元/吨)(wind采用早盘报价)	日	739.0	740.1	1.1	0.15%	
	期现价差(元/吨)	日	-91.52	-72.11	19.4	21.21%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数(美元/吨)	日	90.75	93.25	2.50	2.75%	(40, 160)
	中间价: 澳元兑美元	日	0.6454	0.6468	0.0014	0.22%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费: 西澳到青岛(美元/吨)	日	3.57	3.63	0.06	1.65%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费: 巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	日	6.77	6.70	-0.07	-1.03%	(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	11189	11094.9	-94	-0.84%	(6654, 16281.8)
	日均疏港量(万吨)	周	316.44	300.61	-15.8	-5.00%	(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	171.2	129.0	-42.2	-24.65%
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	39.68%	40.02%	0.34%		
螺纹钢	<p>策略: 多单离场。技术面: 站稳3400上方, 小幅振荡。基本面: 螺纹钢表观需求维持高位, 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。废钢价格进一步涨价, 短流程钢厂亏损加大, 短流程产量小幅下降。</p>						
铁矿石	<p>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, 盘面突破前期压力点650。基本面: 经过3、4月份高发货量后, 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月份相差不多, 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。</p>						
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。