



钢矿早报 2020-5-19

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	3639	3701	62	1.70%	
	现货价格（折算）：天津（元/吨）	日	3709	3801	93	2.50%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3170	3250	80	2.52%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	-175	-173	2	1.22%	(-1220, 205)
	即期利润：河北（元/吨）	日	424	472	48	11.38%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	-150	-90	60	-39.88%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-284	-207	77	27.21%	
	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	20469	20469	0	0.00	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	28.64	30.93	2.29	8.00%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	740.1	764.0	23.9	3.23%	
	期现价差（元/吨）	日	-72.11	-72.52	-0.4	-0.57%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	93.25	96.15	2.90	3.11%	(40, 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.6468	0.6426	-0.0042	-0.65%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	3.63	3.94	0.31	8.66%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	6.70	6.98	0.28	4.18%	(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	129.0	148.1	19.1	14.81%	
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	40.02%	40.59%	0.57%		
螺纹钢	策略：暂时观望。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，建材成交量再一次放量，铁水从热卷向螺纹转移，长流程螺纹产量明显加快，长流程利润中性。短流程钢厂亏损小幅缩小，短流程产量小幅下降。						
铁矿石	策略：多单继续持有，出现成交量放量以及持仓量明显减少，即可止盈离场。技术面：多头趋势明显，突破680。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月份相差不大，日均疏港量拐点向下，5月份港口铁矿石排除出现明显累库。						
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。