



钢矿早报 2020-5-22

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	3722	3711	-10	-0.28%	
	现货价格（折算）：天津（元/吨）	日	3863	3863	0	0.00%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3270	3270	0	0.00%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	-191	-143	47	24.81%	(-1220, 205)
	即期利润：河北（元/吨）	日	467	466	-2	-0.37%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	-70	-80	-10	14.20%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-147	-172	-25	-17.22%	
	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	19290	19290	0	0.00	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	20.56	22.76	2.2	10.70%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	792.3	791.2	-1.1	-0.14%	
	期现价差（元/吨）	日	-87.78	-69.20	18.6	21.17%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	96.10	97.95	1.85	1.93%	(40, 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.6545	0.6589	0.0043	0.66%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	4.46	4.68	0.23	5.10%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	7.46	7.87	0.41	5.50%	(5.35, 108.75)
	澳洲铁矿发运量（至中国, 万吨）	周	1324.00	1395.60	71.60	5.41%	(307.8, 1565.4)
	巴西铁矿发运量（万吨）	周	461.80	394.2	-68	-14.64%	(342.7, 1047.13)
	北方六港到货量（万吨）	周	1099.00	1037	-62	-5.64%	(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	140.5	193.9	53.4	38.01%	
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	40.46%	40.68%	0.21%		
螺纹钢	策略：暂时观望。技术面：站稳3500上方,小幅振荡。基本面：螺纹钢表观需求维持高位，建材成交量回到旺季正常水平，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，短流程产量小幅波动。						
铁矿石	策略：轻仓做多。技术面：多头趋势明显，突破720。基本面：5月下旬至6月上旬港口库存小幅波动，基本面推动盘面进一步上涨动力不足。从资金面和技术面来看，短期盘面仍在保持强势走势，若出现成交量放量，可视为阶段性多空博弈结束。						
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。