



钢矿早报|2020-8-5

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	3753	3814	62	1.65%	
	现货价格（折算）：天津（元/吨）	日	3977	3997	21	0.52%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3390	3390	0	0.00%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	24	22	-3	11.69%	(-1220, 205)
	即期利润：河北（元/吨）	日	335	339	4	1.30%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	-142	-82	60	-42.34%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-163	-219	-56	-34.19%	
	全国钢厂盈利面（%）	周	81.60	81.60	0.00	0.00%	(3.07, 92.59)
	全国高炉开工率（%）	周	70.17	70.3	0.13	0.19%	(61.88, 96.8)
	重点钢企粗钢日均产量（万吨）	旬	213.07	213.84	0.77	0.36%	(140, 200.57)
	重点钢企钢材库存（万吨）	旬	1361.59	1438.18	76.59	5.63%	(1134.1, 1746)
	螺纹社会库存（万吨）	周	854.70	860.71	6.01	0.70%	(288.9, 970)
	沪终端线螺采购量（吨）	周	27960	23800	-4160	-14.88%	(2000, 50000)
	仓单(吨)	日	9478	10969	1491	0.16	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	30.54	20.42	-10.12	-33.14%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	931.4	942.3	10.9	1.17%	
	期现价差（元/吨）	日	-81.91	-69.28	12.6	15.42%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	116.35	118	1.65	1.42%	(40, 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.7138	0.7113	-0.0025	-0.35%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	7.16	7.61	0.45	6.35%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	17.47	17.83	0.36	2.06%	(5.35, 108.75)
	澳洲铁矿发运量（至中国,万吨）	周	1488.80	1421.50	-67.30	-4.52%	(307.8, 1565.4)
	巴西铁矿发运量（万吨）	周	561.80	670.9	109	19.42%	(342.7, 1047.13)
	北方六港到货量（万吨）	周	1510.00	1286	-224	-14.83%	(686.7, 1516.5)
	港口库存（万吨）	周	11325	11402.72	78	0.69%	(6654, 16281.8)
	日均疏港量（万吨）	周	280.35	310.87	30.5	10.89%	(178.8, 307.89)
	大中钢厂库存可用天数（天）	周	24.0	24.0	0.0	0.00%	(19, 37)
	港口铁矿石累计成交量	日	128.5	190.5	62.0	48.25%	
铁矿石期权	90天历史波动率	日	30.22%	30.39%	0.17%		
钢材	策略：螺纹热卷01合约多单继续持有。技术面：多头排列。基本面：弱现实，强预期，华东期现结构将出现平水或者升水。目前螺纹钢供强需弱，这种结构转变可能发生在8月份，高频数据建材成交量波动较大，市场关注雨季过后下游需求回暖程度。热卷供需两强，产量偏高，下游需求中性。做多01合约核心逻辑在于，预判下半年终端需求强劲，钢材供给中性，特别是制造业回暖，缓解螺纹钢供给压力。						
铁矿石	策略：铁矿石2101合约多单持有。技术面：多头排列。基本面：发货量环比走弱，到港量高位，疏港量和铁水产量高位运行，港口粉矿库存低位。做多01合约核心逻辑在于，预判下半年终端需求强劲，铁水产量维持高位，铁矿石供给中性，港口主流粉矿不会趋势积累。近期铁矿石走势手其金融属性影响较强，市场参与者需要重点关注。						
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。