



信达期货
CINDA FUTURES

钢矿早报 2020-8-25

联系人: 臧加利
执业咨询号: Z0015613
电话: 18616219409
zangjiali@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	3814	3814	0	0.00%	
	现货价格(折算): 天津(元/吨)	日	3935	3935	0	0.00%	
	现货价格: 唐山方坯(元/吨)(早)	日	3410	3410	0	0.00%	
	期现价差: 上海(元/吨)	日	-31	-33	-2	-6.36%	(-1220, 205)
	即期利润: 河北(元/吨)	日	82	82	0	0.00%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润: 华东(元/吨)	日	-107	-107	0	0.00%	
	电炉螺纹钢利润: 华北(元/吨)	日	-292	-292	0	0.00%	
	全国钢厂盈利面(%)	周	82.21	82.21	0.00	0.00%	(3.07, 92.59)
	全国高炉开工率(%)	周	71.27	71.13	-0.14	-0.20%	(61.88, 96.8)
	重点钢企粗钢日均产量(万吨)	旬	217.24	215.34	-1.90	-0.87%	(140, 200.57)
	重点钢企钢材库存(万吨)	旬	1313.14	1399.16	86.02	6.55%	(1134.1, 1746)
	螺纹社会库存(万吨)	周	858.60	866.82	8.22	0.96%	(288.9, 970)
	沪终端线螺采购量(吨)	周	27900	27500	-400	-1.43%	(2000, 50000)
	仓单(吨)	日	48765	54984	6219	0.13	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	22.3	24.21	1.91	8.57%	
铁矿石	价格(折算): 61.5%PB粉(元/吨)(wind采用早盘报价)	日	1045.5	1045.5	0.0	0.00%	
	期现价差(元/吨)	日	-204.04	-213.04	-9.0	-4.41%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数(美元/吨)	日	126.65	124.45	-2.20	-1.74%	(40, 160)
	中间价: 澳元兑美元	日	0.7198	0.7166	-0.0032	-0.44%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费: 西澳到青岛(美元/吨)	日	7.53	7.23	-0.30	-3.92%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费: 巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	日	17.41	17.12	-0.29	-1.67%	(5.35, 108.75)
	澳洲铁矿发运量(至中国, 万吨)	周	1301.40	1420.40	119.00	9.14%	(307.8, 1565.4)
	巴西铁矿发运量(万吨)	周	691.80	757.9	66	9.55%	(342.7, 1047.13)
	北方六港到货量(万吨)	周	1134.00	1330	196	17.28%	(686.7, 1516.5)
	港口库存(万吨)	周	11323	11241.72	-81	-0.72%	(6654, 16281.8)
	日均疏港量(万吨)	周	328.62	327.36	-1.3	-0.38%	(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	131.0	116.0	-15.0	-11.45%	
铁矿石期权	90天历史波动率	日	32.74%	32.84%	0.11%		
钢材	<p>策略: 多热卷01合约空螺纹钢01合约。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。目前螺纹钢供需弱, 这种结构已经开始逐步转变, 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, 下游需求高位。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。近期螺纹钢表观需求偏弱, 热卷表观需求偏强。</p>						
铁矿石	<p>策略: 回调做多。技术面: 短期回调。基本面: 发货量较上半年走弱, 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。近期铁矿石走势受到金融属性影响较强, 市场参与者需要重点关注。</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。