



钢矿早报 | 2020-8-31

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	3925	-10	-0.26%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3400	3410	10	0.29%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	-97	-80	17	17.45%	(-1220, 205)
	即期利润：河北（元/吨）	日	120	114	-7	-5.42%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	-145	-145	0	0.00%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-292	-302	-10	-3.43%	
	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	71.13	70.99	-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	866.82	878.08	11.26	1.30%	(288.9, 970)
	沪终端线螺采购量（吨）	周	28600	26400	-2200	-7.69%	(2000, 50000)
	仓单(吨)	日	56765	59160	2395	0.04	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	18.86	24.39	5.53	29.32%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	1021.6	1019.5	-2.2	-0.21%	
	期现价差（元/吨）	日	-207.13	-186.96	20.2	9.74%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	121.20	123.25	2.05	1.69%	(40, 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.7234	0.7258	0.0024	0.33%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	8.37	8.25	-0.12	-1.47%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	18.12	18.32	0.20	1.10%	(5.35, 108.75)
	澳洲铁矿发运量（至中国,万吨）	周	1420.40	1518.80	98.40	6.93%	(307.8, 1565.4)
	巴西铁矿发运量（万吨）	周	757.90	682.8	-75	-9.91%	(342.7, 1047.13)
	北方六港到货量（万吨）	周	1330.00	1378.2	48	3.62%	(686.7, 1516.5)
	港口库存（万吨）	周	11242	11310.48	69	0.61%	(6654, 16281.8)
	日均疏港量（万吨）	周	327.36	310.66	-16.7	-5.10%	(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	133.0	188.0	55.0	41.35%	
铁矿石期权	90天历史波动率	日	31.72%	31.98%	0.26%		
钢材	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。目前螺纹钢供强需弱，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。						
铁矿石	策略：回调企稳做多。技术面：短期回调。基本面：铁矿石供需两旺，铁水产量、疏港量、到港量高位运行，港口总库存区间窄幅波动，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，期货高贴水。注意短期终端需求回升速度较慢，带来的铁矿石回调压力。						
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。