



钢矿早报 2020-9-15

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	3856	3866	10	0.27%	
	现货价格（折算）：天津（元/吨）	日	3915	3946	31	0.79%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3400	3430	30	0.88%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	-191	-202	-11	-5.93%	(-1220, 205)
	即期利润：河北（元/吨）	日	81	102	21	26.43%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	-130	-108	23	-17.38%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-388	-358	30	7.73%	
	全国钢厂盈利面（%）	周	82.21	81.60	-0.61	-0.74%	(3.07, 92.59)
	全国高炉开工率（%）	周	70.72	70.17	-0.55	-0.78%	(61.88, 96.8)
	重点钢企粗钢日均产量（万吨）	旬	216.10	216.02	-0.08	-0.04%	(140, 200.57)
	重点钢企钢材库存（万吨）	旬	1372.51	1236.96	-135.55	-9.88%	(1134.1, 1746)
	螺纹社会库存（万吨）	周	891.62	893.58	1.96	0.22%	(288.9, 970)
	沪终端线螺采购量（吨）	周	31300	29800	-1500	-4.79%	(2000, 50000)
	仓单(吨)	日	95792	96678	886	0.01	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	26.63	25.72	-0.91	-3.42%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	1017.3	1020.5	3.3	0.32%	
	期现价差（元/吨）	日	-180.28	-172.04	8.2	4.57%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	129.05	129.05	0.00	0.00%	(40, 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.7264	0.7278	0.0014	0.19%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	6.68	7.00	0.32	4.76%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	15.63	15.61	-0.03	-0.16%	(5.35, 108.75)
	澳洲铁矿发运量（至中国,万吨）	周	1304.20	1203.70	-100.50	-7.71%	(307.8, 1565.4)
	巴西铁矿发运量（万吨）	周	873.30	692	-181	-20.76%	(342.7, 1047.13)
	北方六港到货量（万吨）	周	1284.90	1298	13	1.02%	(686.7, 1516.5)
	港口库存（万吨）	周	11374	11456.45	82	0.72%	(6654, 16281.8)
	日均疏港量（万吨）	周	325.55	313.83	-11.7	-3.60%	(178.8, 307.89)
	大中钢厂库存可用天数（天）	周	25.0	24.0	-1.0	-4.00%	(19, 37)
	港口铁矿石累计成交量	日	136.0	194.0	58.0	42.65%	
铁矿石期权	90天历史波动率	日	29.29%	29.39%	0.09%		
钢材	策略：观望。技术面：短期回调。基本面：弱现实，强预期，华东期现结构小幅贴水。螺纹钢供给边际转弱，需求边际转好，高频数据建材成交量高位波动，市场关注金九银十需求强度。热卷供需两强，产量偏高，下游需求高位，但近期边际转弱。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：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。						
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。