钢矿早报 2020-10-20

信达期货 CINDA FUTURES

联系人：臧加利
执业咨询号：Z0015613
从业资格号：F3049542
电话：18616219409
zangjiali@cindasc.com

联系人：方家驹
执业编号：F3066474
电话：0571-28132639
fangjiaju@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	3956	3966	10	0.26%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3400	3420	20	0.59%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	-224	-255	-31	-14.00%	（-1220,205）
	即期利润：河北（元/吨）	日	178	187	8	4.63%	（-300，1820）
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	-105	-95	10	-9.52%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-348	-338	10	2.87%	
	全国钢厂盈利面（%）	周	78.53	77.91	-0.62	-0.79%	（3.07，92.59）
	全国高炉开工率（%）	周	68.09	68.78	0.69	1.01%	（61.88，96.8）
	重点钢企粗钢日均产量（万吨）	旬	214.56	218.87	4.31	2.01%	（140， 200.57）
	重点钢企钢材库存（万吨）	旬	1340.49	1159.61	-180.88	-13.49%	（1134.1，1746）
	螺纹社会库存（万吨）	周	831.89	777.68	-54.21	-6.52%	（288.9，970）
	沪终端线螺采购量（吨）	周	21800	31200	9400	43.12%	（2000， 50000）
	仓单(吨)	日	69804	62696	-7108	-0.10	(0， 92176)
	建材每日成交量	日	25.5	24.57	-0.93	-3.65%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	944.5	949.9	5.4	0.58%	
	期现价差（元/吨）	日	-158.96	-168.89	-9.9	-6.25%	(-164.52， 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	119.05	119.4	0.35	0.29%	(40， 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.7090	0.7089	-0.0001	-0.01%	（0.687，1.103）
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	7.80	7.67	-0.13	-1.69%	（2.84，50.85）
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	18.07	16.53	-1.54	-8.52%	（5.35，108.75）
	澳洲铁矿发运量（至中国，万吨）	周	1463.90	1464.00	0.10	0.01%	（307.8，1565.4）
	巴西铁矿发运量（万吨）	周	767.80	688	-80	-10.39%	（342.7，1047.13）
	北方六港到货量（万吨）	周	1343.30	1314.8	-29	-2.12%	（686.7， 1516.5）
	港口库存（万吨）	周	12061	12238.52	178	1.47%	(6654，16281.8)
	日均疏港量（万吨）	周	317.70	311.85	-5.8	-1.84%	（178.8，307.89）
	大中钢厂库存可用天数（天）	周	24.0	29.0	5.0	20.83%	(19， 37)
	港口铁矿石累计成交量	日	155.0	135.0	-20.0	-12.90%	
铁矿石期权	90天历史波动率	日	29.25%	29.26%	0.02%		

钢材

策略：boll中轨附近做多，或者多热卷空螺纹。技术面：站稳boll通道中轨。基本面：螺纹钢供给边际转弱，需求边际转好，供需转暖，进口钢铁资源影响弱化，去库加快。热卷供需转好，产量季节性下滑，下游需求高位。关注点：终端需求强度，库存去化斜率。

铁矿石

策略：观望。技术面：重新站上boll通道中轨。基本面：驱动向下，估值高位，供需两旺，铁水产量、疏港量、到港量高位运行，港口总库存小幅上升，港口粉矿库存低位。关注点：日均铁水产量，终端需求强度。

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。