

钢矿早报|2020-12-15

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	4330	4299	-31	-0.71%	
	现货价格（折算）：天津（元/吨）	日	4131	4121	-10	-0.25%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3680	3640	-40	-1.09%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	-297	-311	-14	-4.74%	(-1220, 205)
	即期利润：河北（元/吨）	日	-19	-50	-31	159.19%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	355	325	-30	-8.45%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-178	-188	-10	-5.62%	
	全国钢厂盈利面（%）	周	80.37	80.37	0.00	0.00%	(3.07, 92.59)
	全国高炉开工率（%）	周	66.85	66.57	-0.28	-0.42%	(61.88, 96.8)
	重点钢企粗钢日均产量（万吨）	旬	211.34	210.57	-0.77	-0.36%	(140, 200.57)
	重点钢企钢材库存（万吨）	旬	1256.98	1137.21	-119.77	-9.53%	(1134.1, 1746)
	螺纹社会库存（万吨）	周	426.50	396.11	-30.39	-7.13%	(288.9, 970)
	沪终端线螺采购量（吨）	周	23700	29600	5900	24.89%	(2000, 50000)
	仓单(吨)	日	1500	1500	0	0.00	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	19.65	19.44	-0.21	-1.07%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	1116.2	1130.3	14.1	1.27%	
	期现价差（元/吨）	日	-126.70	-164.33	-37.6	-29.70%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	160.70	154.5	-6.20	-3.86%	(40, 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.7528	0.7548	0.0019	0.26%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	6.76	6.99	0.24	3.49%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	12.33	13.07	0.73	5.96%	(5.35, 108.75)
	澳洲铁矿发运量（至中国，万吨）	周	1276.70	1312.70	36.00	2.82%	(307.8, 1565.4)
	巴西铁矿发运量（万吨）	周	707.30	565.9	-141	-19.99%	(342.7, 1047.13)
	北方六港到货量（万吨）	周	1096.00	983.1	-113	-10.30%	(686.7, 1516.5)
	港口库存（万吨）	周	12447	12203.2	-243	-1.96%	(6654, 16281.8)
	日均疏港量（万吨）	周	319.11	306.15	-13.0	-4.06%	(178.8, 307.89)
	大中钢厂库存可用天数（天）	周	26.0	26.0	0.0	0.00%	(19, 37)
	港口铁矿石累计成交量	日	75.0	102.0	27.0	36.00%	
铁矿石期权	90天历史波动率	日	30.13%	30.46%	0.33%		
钢材	策略：观望。技术面：高位震荡。基本面：绝对驱动边际向下，但整个绝对驱动较好，期现货估值偏高，期货贴水较高；螺纹钢供给稳定，需求环比下降、同比持平，进口钢铁资源影响弱化，去库加快。热卷供需两旺，产量季节性回升，下游需求高位。关注点：终端需求同比强度，库存去化斜率。政策面：钢铁协会组织中国宝武、沙钢、鞍钢、首钢、河钢、华菱钢铁和建龙等钢铁企业召开铁矿石市场座谈会，就近期市场运行等问题进行了研讨。与会企业一致认为，当前铁矿石价格上涨已偏离供需基本面，大幅超出钢厂预期，资本炒作迹象明显。						
铁矿石	策略：观望。技术面：高位震荡。基本面：驱动逐渐向上，估值高位，期货贴水中性。铁水产量高位稳定，发货量高点下移，到港量继续下降，疏港量高位，港口总库存小幅下降，港口粉矿库存低位平稳运行。关注点：日均铁水产量，终端需求强度，铁矿发运量，钢厂补库。政策面：大商所发布《关于就铁矿石定期调整品牌升贴水及增设可交割品牌公开征求意见》的公告，铁矿石期货拟定期调整品牌升贴水。三种备选方案调整频率分别为每半年、每季度或每月调整。						
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。