

钢矿早报|2020-12-22

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	4515	4804	289	6.39%	
	现货价格（折算）：天津（元/吨）	日	4245	4482	237	5.59%	
	现货价格：唐山方坯（元/吨）（早	日	3730	4000	270	7.24%	
	期现价差：上海（元/吨）	日	-199	-344	-145	-72.52%	(-1220, 205)
	即期利润：河北（元/吨）	日	22	123	101	457.76%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润：华东（元/吨）	日	535	815	280	52.34%	
	电炉螺纹钢利润：华北（元/吨）	日	-68	162	230	338.83%	
	全国钢厂盈利面（%）	周	80.37	79.14	-1.23	-1.53%	(3.07, 92.59)
	全国高炉开工率（%）	周	66.57	66.85	0.28	0.42%	(61.88, 96.8)
	重点钢企粗钢日均产量（万吨）	旬	210.57	220.25	9.68	4.60%	(140, 200.57)
	重点钢企钢材库存（万吨）	旬	1137.21	1267.97	130.76	11.50%	(1134.1, 1746)
	螺纹社会库存（万吨）	周	396.11	372.4	-23.71	-5.99%	(288.9, 970)
	沪终端线螺采购量（吨）	周	29600	28500	-1100	-3.72%	(2000, 50000)
	仓单(吨)	日	1500	1500	0	0.00	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	20.69	29.16	8.47	40.94%	
铁矿石	价格（折算）：61.5%PB粉（元/吨）（wind采用早盘报价）	日	1146.6	1226.0	79.3	6.92%	
	期现价差（元/吨）	日	-73.13	-81.48	-8.3	-11.41%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数（美元/吨）	日	164.15	176.9	12.75	7.77%	(40, 160)
	中间价：澳元兑美元	日	0.7615	0.7593	-0.0022	-0.29%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费:西澳到青岛（美元/吨）	日	7.10	7.24	0.14	1.99%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费:巴西图巴朗-青岛（美元/	日	15.08	15.64	0.57	3.75%	(5.35, 108.75)
	澳洲铁矿发运量（至中国，万吨）	周	1312.70	1267.50	-45.20	-3.44%	(307.8, 1565.4)
	巴西铁矿发运量（万吨）	周	565.90	634	68	12.03%	(342.7, 1047.13)
	北方六港到货量（万吨）	周	983.10	1138.6	156	15.82%	(686.7, 1516.5)
	港口库存（万吨）	周	12203	12404.45	201	1.65%	(6654, 16281.8)
	日均疏港量（万吨）	周	306.15	297.16	-9.0	-2.94%	(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	169.5	223.0	53.5	31.56%	
铁矿石期权	90天历史波动率	日	30.32%	32.48%	2.16%		
钢材	策略：观望。技术面：高位震荡偏强。基本面：螺纹绝对驱动边际向下，但整个绝对驱动较好，期现货估值偏高，期现货贴水较高；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。消息面：本周末，唐山昌黎地区钢厂普方坯累涨150，报3880。						
铁矿石	策略：观望。技术面：高位震荡偏强。基本面：驱动向上，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：大商所发布通知，自12月22日交易时起，非期货公司会员或者客户在铁矿石期货各月份合约上单日开仓量不得超过2,000手。该单日开仓量是指非期货公司会员或者客户当日在铁矿石期货单个合约上的买开仓数量与卖开仓数量之和。						
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。