



信达期货
CINDA FUTURES

钢矿早报 2021-1-14

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	4474	-41	-0.91%	
	现货价格(折算): 天津(元/吨)	日	4389	4358	-31	-0.70%	
	现货价格: 唐山方坯(元/吨)(早	日	3810	3810	0	0.00%	
	期现价差: 上海(元/吨)	日	-188	-181	7	3.84%	(-1220, 205)
	即期利润: 河北(元/吨)	日	-114	-199	-85	74.64%	(-300, 1820)
	电炉螺纹钢利润: 华东(元/吨)	日	535	495	-40	-7.48%	
	电炉螺纹钢利润: 华北(元/吨)	日	72	42	-30	41.60%	
	全国钢厂盈利面(%)	周	78.53	77.30	-1.23	-1.57%	(3.07, 92.59)
	全国高炉开工率(%)	周	67.54	66.85	-0.69	-1.02%	(61.88, 96.8)
	重点钢企粗钢日均产量(万吨)	旬	220.16	216.29	-3.87	-1.76%	(140, 200.57)
	重点钢企钢材库存(万吨)	旬	1305.05	1162.11	-142.94	-10.95%	(1134.1, 1746)
	螺纹社会库存(万吨)	周	363.87	395.58	31.71	8.71%	(288.9, 970)
	沪终端线螺采购量(吨)	周	21500	18600	-2900	-13.49%	(2000, 50000)
	仓单(吨)	日	76686	95031	18345	0.24	(0, 92176)
	建材每日成交量	日	13.34	12.78	-0.56	-4.20%	
铁矿石	价格(折算): 61.5%PB粉(元/吨)(wind采用早盘报价)	日	1240.1	1248.8	8.7	0.70%	
	期现价差(元/吨)	日	-191.11	-214.80	-23.7	-12.40%	(-164.52, 40.02)
	普氏指数(美元/吨)	日	171.35	169	-2.35	-1.37%	(40, 160)
	中间价: 澳元兑美元	日	0.7705	0.7761	0.0056	0.73%	(0.687, 1.103)
	铁矿运费: 西澳到青岛(美元/吨)	日	9.99	10.51	0.52	5.26%	(2.84, 50.85)
	铁矿运费: 巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	日	19.28	20.93	1.65	8.56%	(5.35, 108.75)
	澳洲铁矿发运量(至中国, 万吨)	周	1582.60	1356.80	-225.80	-14.27%	(307.8, 1565.4)
	巴西铁矿发运量(万吨)	周	760.60	453.3	-307	-40.40%	(342.7, 1047.13)
	北方六港到货量(万吨)	周	1011.70	1155.7	144	14.23%	(686.7, 1516.5)
	港口库存(万吨)	周	12416	12267.2	-149	-1.20%	(6654, 16281.8)
	日均疏港量(万吨)	周	280.10	302.26	22.2	7.91%	(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	163.7	132.5	-31.2	-19.06%	
铁矿石期权	90天历史波动率	日	37.74%	37.92%	0.18%		
钢材	<p>策略: 观望。技术面: 高位宽幅震荡。基本面: 螺纹钢需求季节性转弱, 驱动边际向下, 估值历史高位。加上敬业钢厂的螺纹钢价格相对较低, 螺纹钢注册仓单量大幅增加, 从而对螺纹钢近月合约价格形成了一定的压制。热卷供需转弱, 迎来库存拐点, 同时绝对价格过高, 钢厂接新订单略乏力, 并且热卷注册仓单也大幅增加。关注点: 累库进度。进出口: 生态环境部发布指导意见称, 全力推进二氧化碳排放达峰行动。抓紧制定2030年前二氧化碳排放达峰行动方案, 综合运用相关政策工具和手段措施, 持续推动实施鼓励能源、工业、交通、建筑等重点领域制定达峰专项方案。推动钢铁、建材、有色、化工、石化、电力、煤炭等重点行业提出明确的达峰目标并制定达峰行动方案。</p>						
铁矿石	<p>策略: 观望。技术面: 高位震荡偏弱。基本面: 近期受到国内外钢铁需求旺盛局面的影响, 铁矿石价格大幅上涨, 但在铁矿高价格的抑制下, 钢厂的冬季补库规模较往年要小, 同时钢厂加大了对高品矿的采购力度。短期铁矿石供给量回升明显, 同时钢材价格面临回调压力, 因此铁矿石价格以高位震荡为主, 不排除下杀高估值的可能性, 然后铁矿现货补跌, 钢厂开始规模性后, 期现价格企稳。关注点: 钢厂补库强度。消息面: 无。</p>						
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。