



长城期货
GREAT WALL FUTURES

螺纹钢、铁矿石 期货品种周报

2024.11.11-11.15



长城期货

深耕期货行业

28年



长城期货
GREAT WALL FUTURES

P A R T

01

螺纹钢期货



长城期货
GREAT WALL FUTURES

目录

Contents

01 中线行情分析

02 品种交易策略

03 相关数据情况



1

中线趋势判断

螺纹钢期货预计将转入震荡偏弱的行情。

2

趋势判断逻辑

供应方面，由于部分钢厂转产卷板等品种，加上部分钢厂因市场需求减少主动停减产，螺纹钢产量降幅扩大。库存方面，整体库存因北方淡季到来而继续累库。需求方面，本周重要会议期间，市场预期较足，终端采购和投机需求均较为积极，但淡季需求转弱已开始对市场情绪造成影响。期货方面，重大宏观事件影响基本结束，市场开始由交易预期转向交易现实，预计螺纹钢期货价格将进入震荡偏弱走势。

3

中线策略建议

建议观望。



■ 上周策略回顾

本周美国大选、美联储议息会议等重要事件的影响即将落地，建议暂时观望，等待对行情的指引。

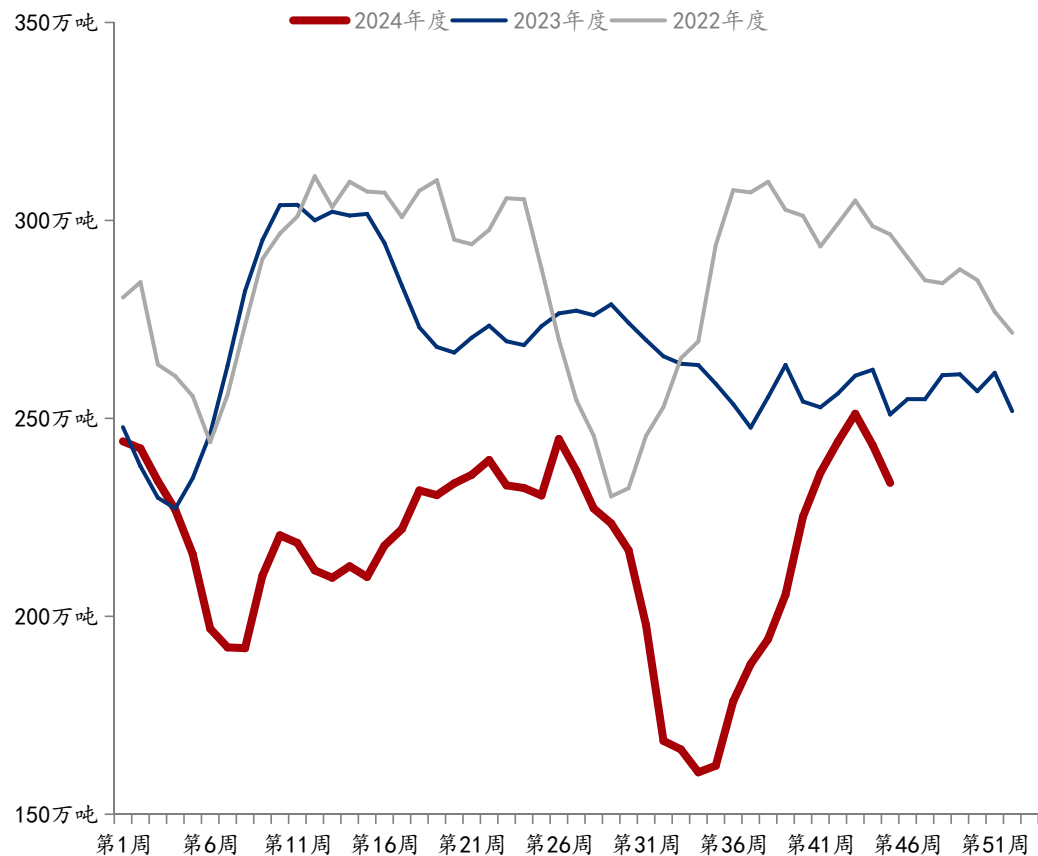
■ 本周策略建议

市场情绪短期偏空，螺纹钢主力2501合约预期波动区间3284-3430，关注3350-3380区间压力。

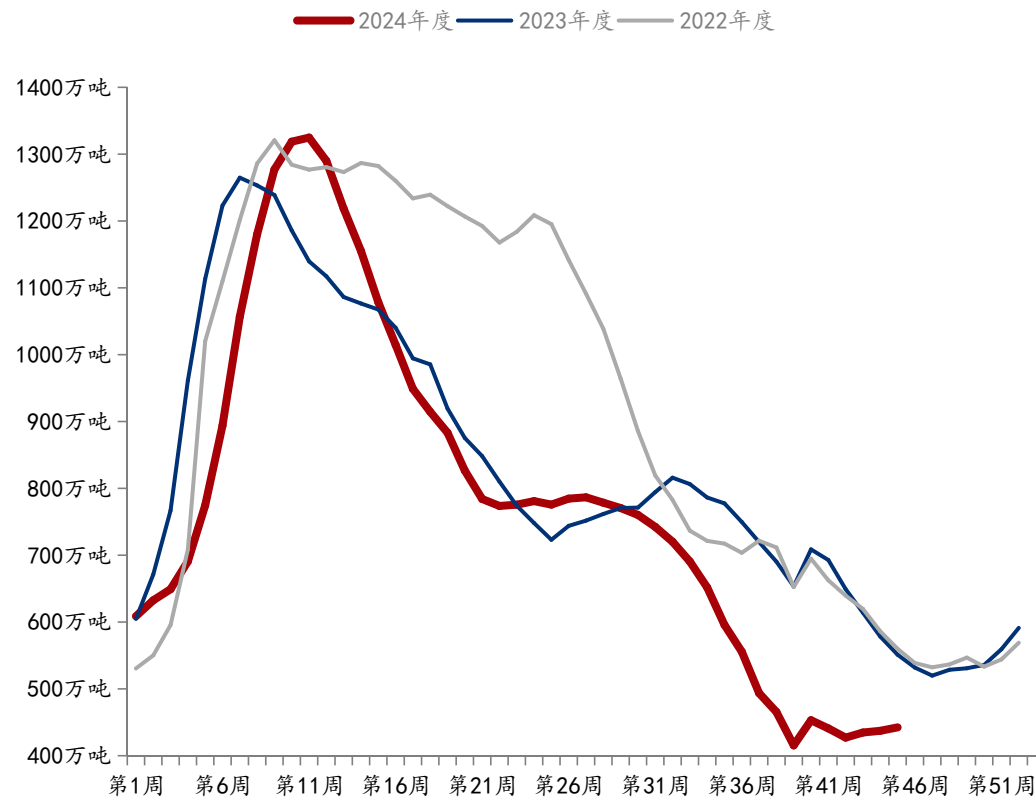
■ 品种套利建议

热轧卷板和螺纹钢价差升至约174，超过200可关注价差缩小的套利机会。螺矿比价降至约4.34，套利继续观望。

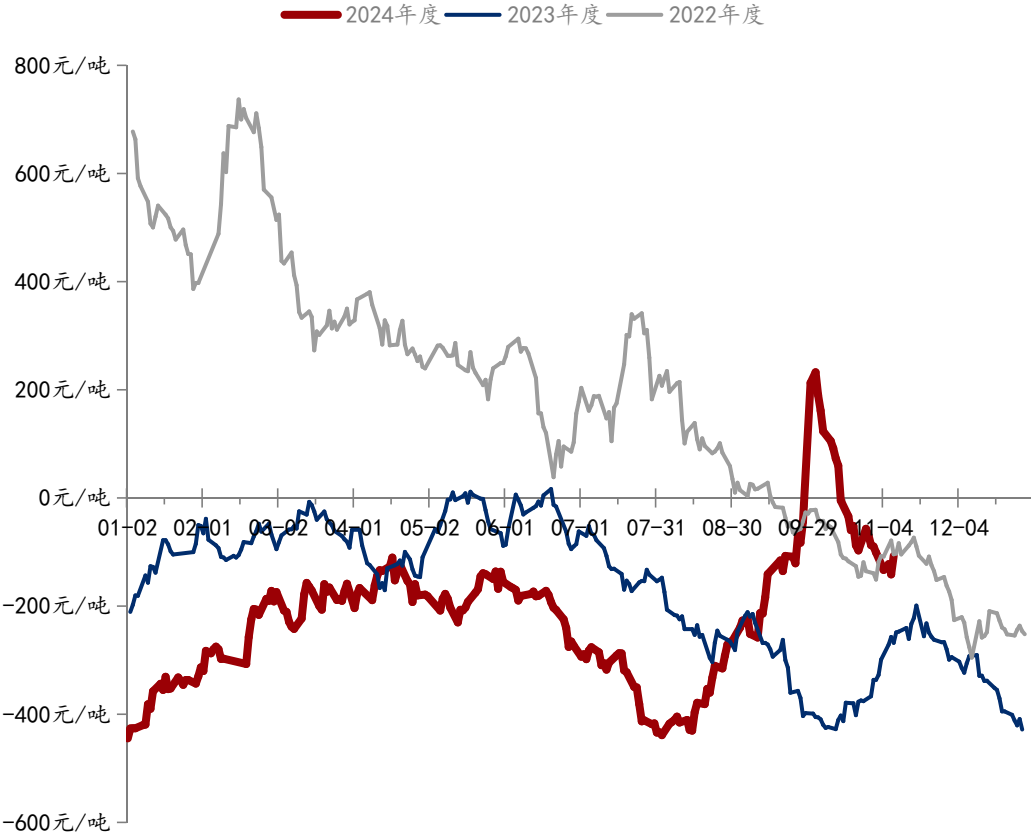
国内螺纹钢产量



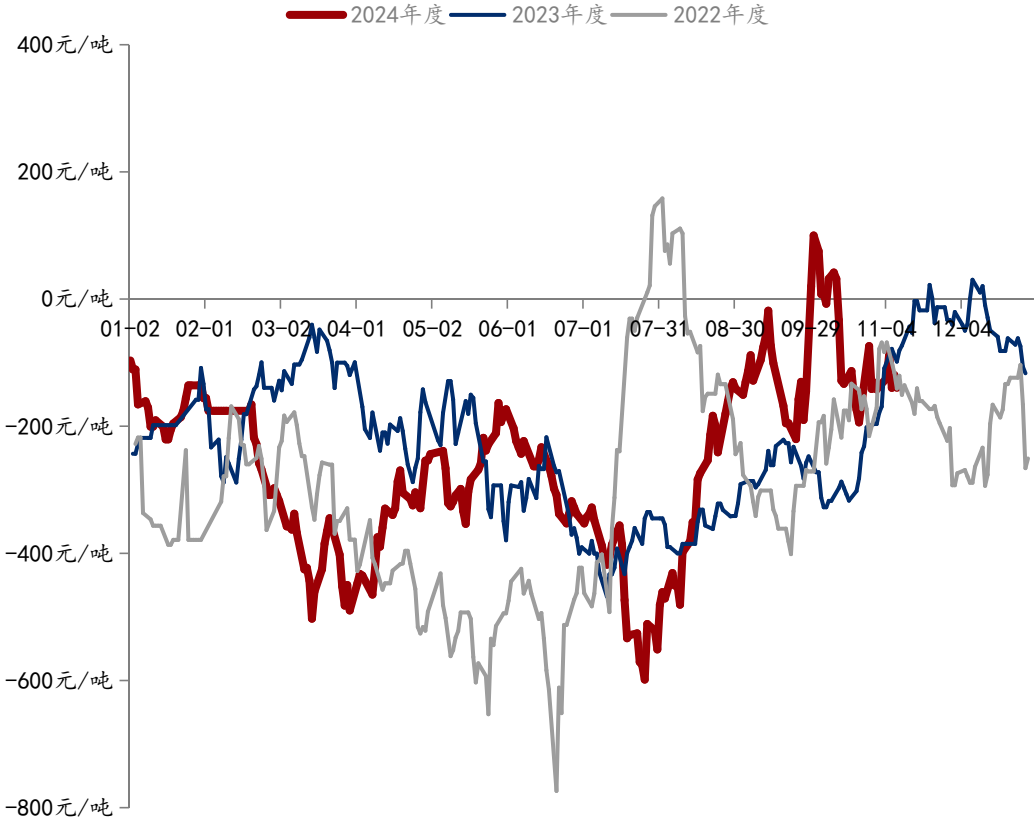
国内螺纹钢库存



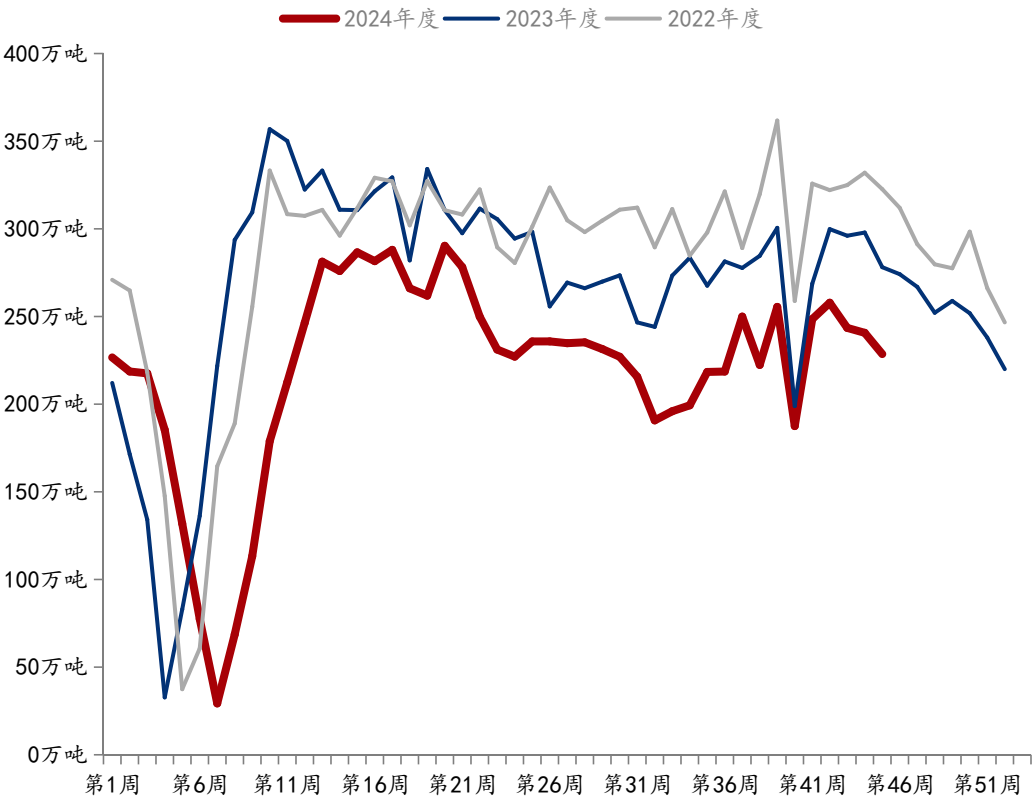
国内螺纹钢高炉利润



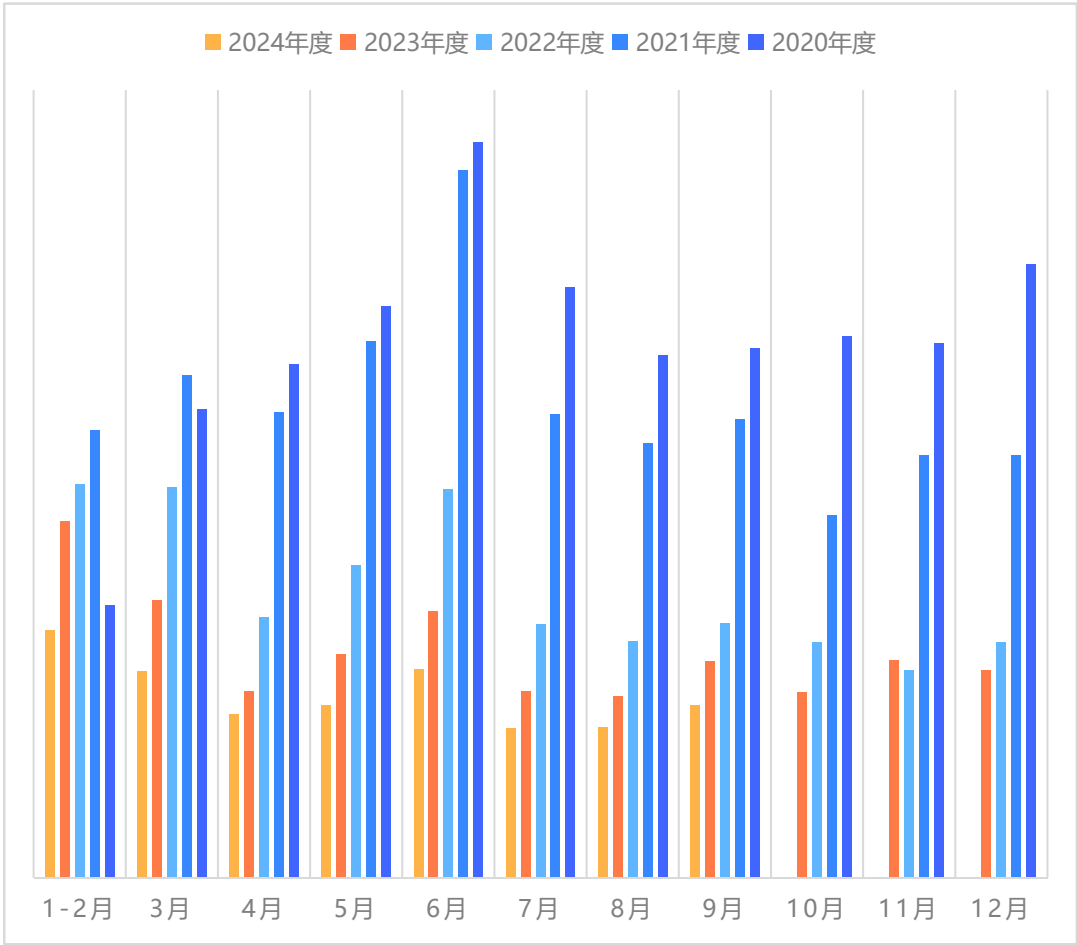
国内螺纹钢电炉利润



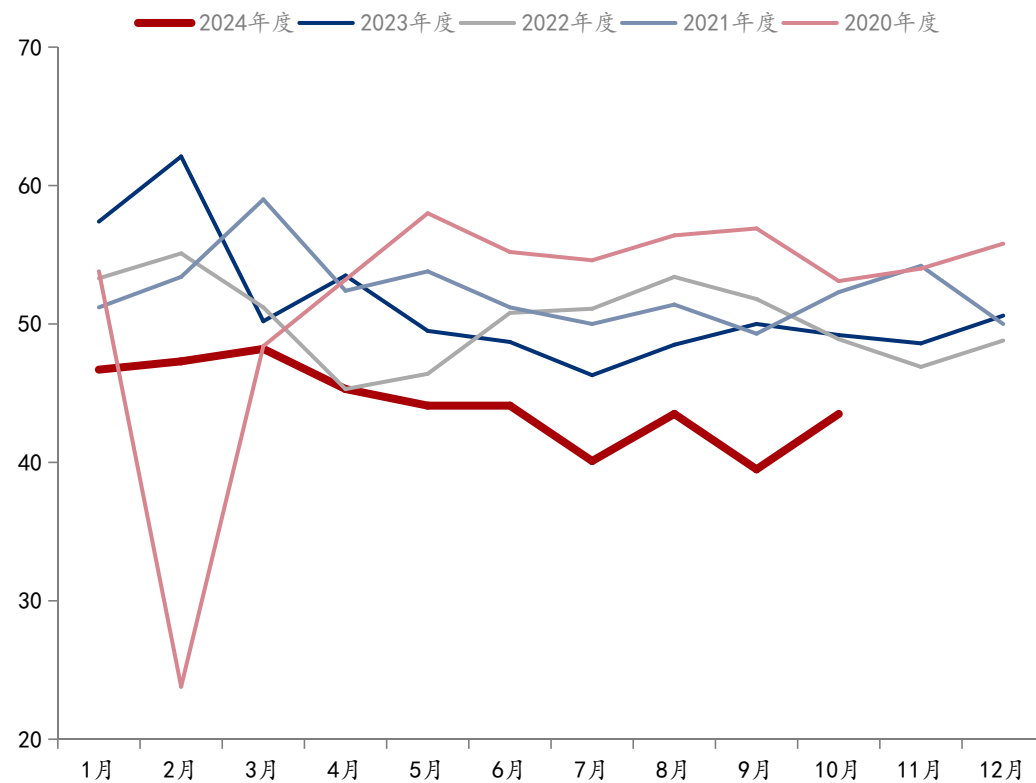
国内螺纹钢表观消费量



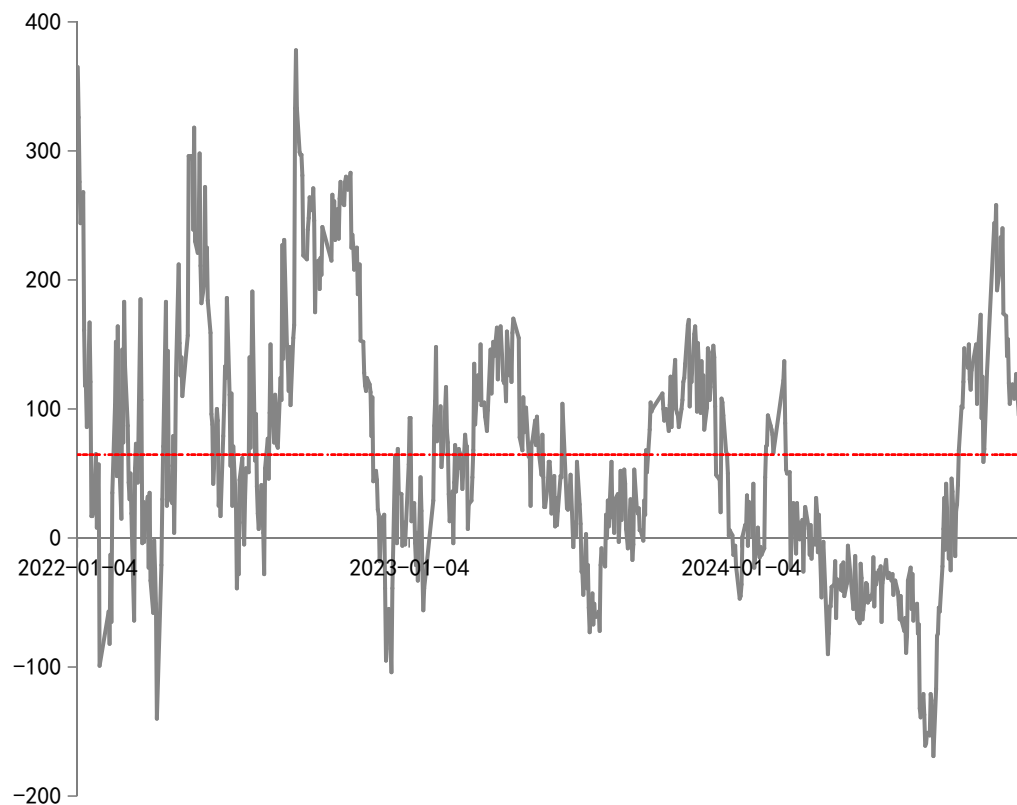
国内房屋新开工面积



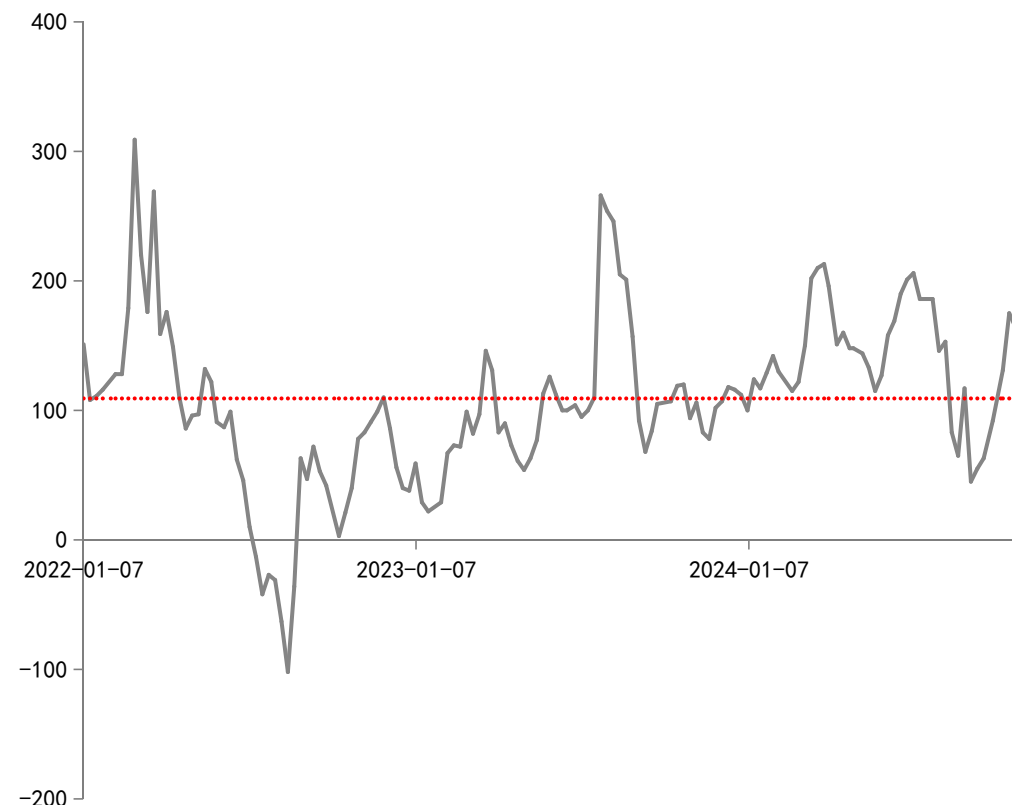
建筑业PMI：新订单指数



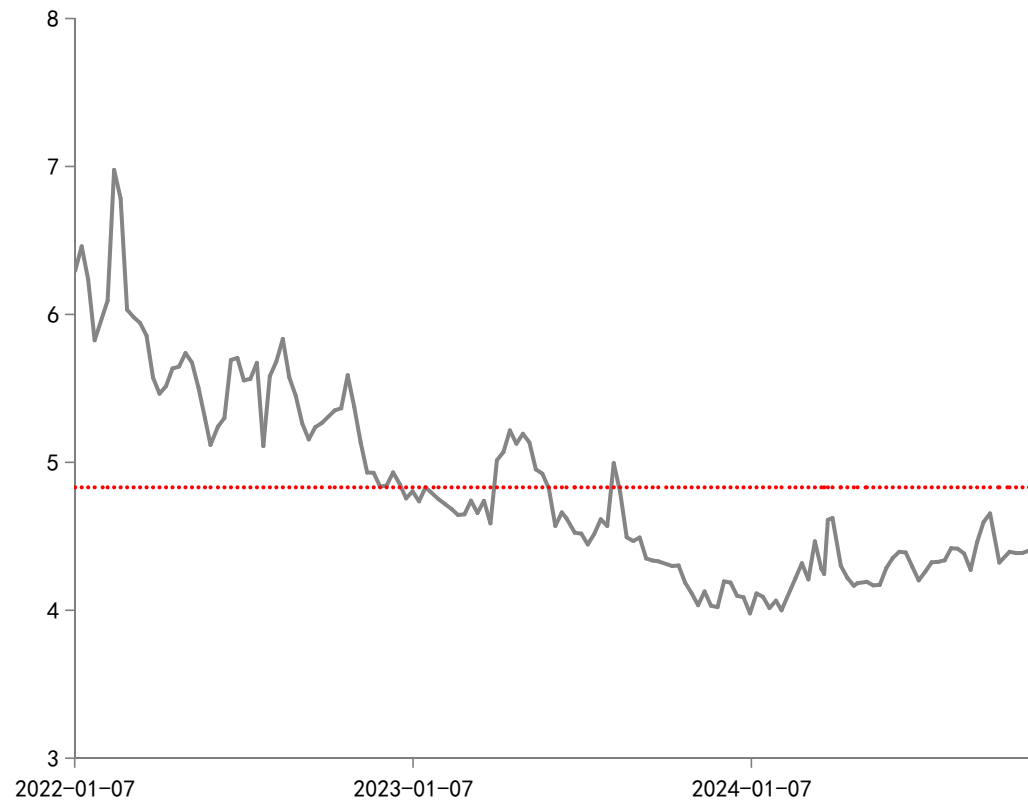
螺纹钢期现基差



卷螺差



螺矿比



< 螺纹(rb) v

品种诊断 机构观点 盈利席位 主力资金 :

- AI品种诊断报告 -

看整体趋势，日线处在横盘阶段，根据近年来行情周期的规律，当前可能已近趋势尾声。

资金方面，主力显示出较强的偏空情绪。同时，资金流入幅度较大，主力关注度上升。



< 螺纹(rb) v

品种诊断 机构观点 盈利席位 主力资金 :

多空流向: -99.8    主力强烈偏空资金能量: 74.3    资金流入幅度较大多空分歧: 83.7    变盘风险较高





长城期货
GREAT WALL FUTURES

P A R T

02

铁矿石期货



长城期货
GREAT WALL FUTURES

目录

Contents

01 中线行情分析

02 品种交易策略

03 相关数据情况



1

中线趋势判断

铁矿石期货预计将进入震荡偏弱走势。

2

趋势判断逻辑

供应方面，上周进口铁矿石到港量回落幅度大于疏港量，港口库存小幅去库。需求方面，市场需求下降令部分钢厂主动开始检修高炉，铁水产量继续小幅回落。期货方面，期货价格由宏观事件驱动转为由基本面驱动，预计铁矿石期货价格将进入震荡偏弱走势。

3

中线策略建议

建议观望。



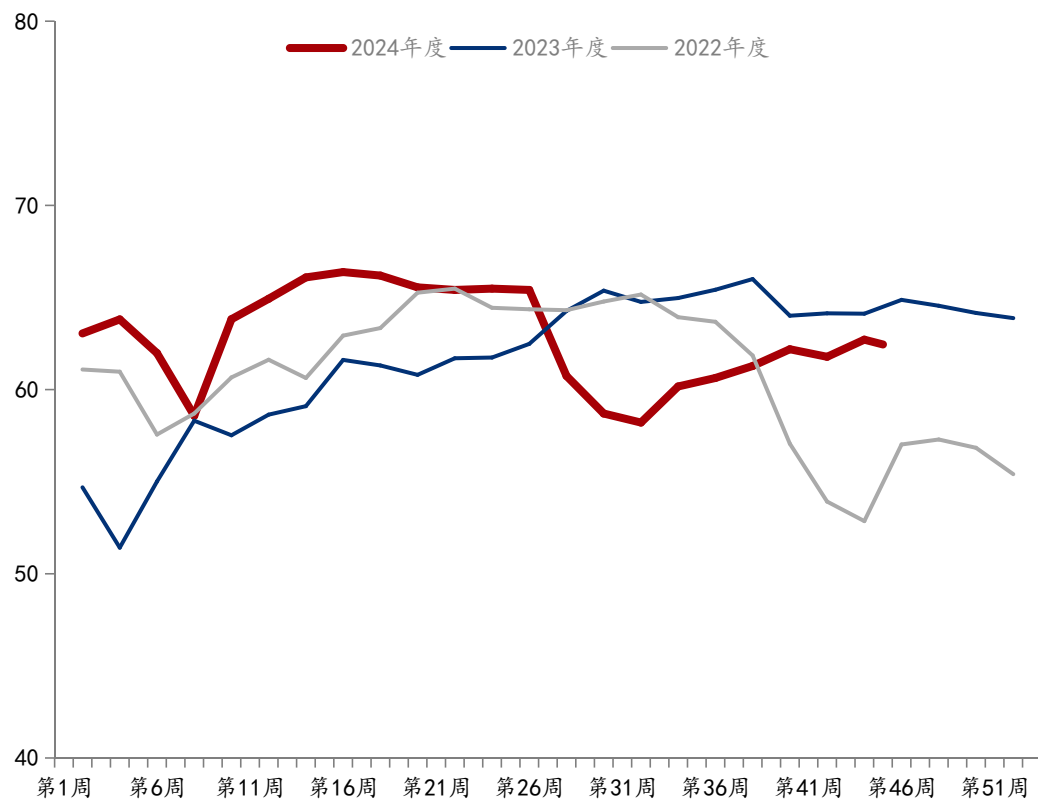
■ 上周策略回顾

本周美国大选、美联储议息会议等重要事件的影响即将落地，建议暂时观望，等待对行情的指引。

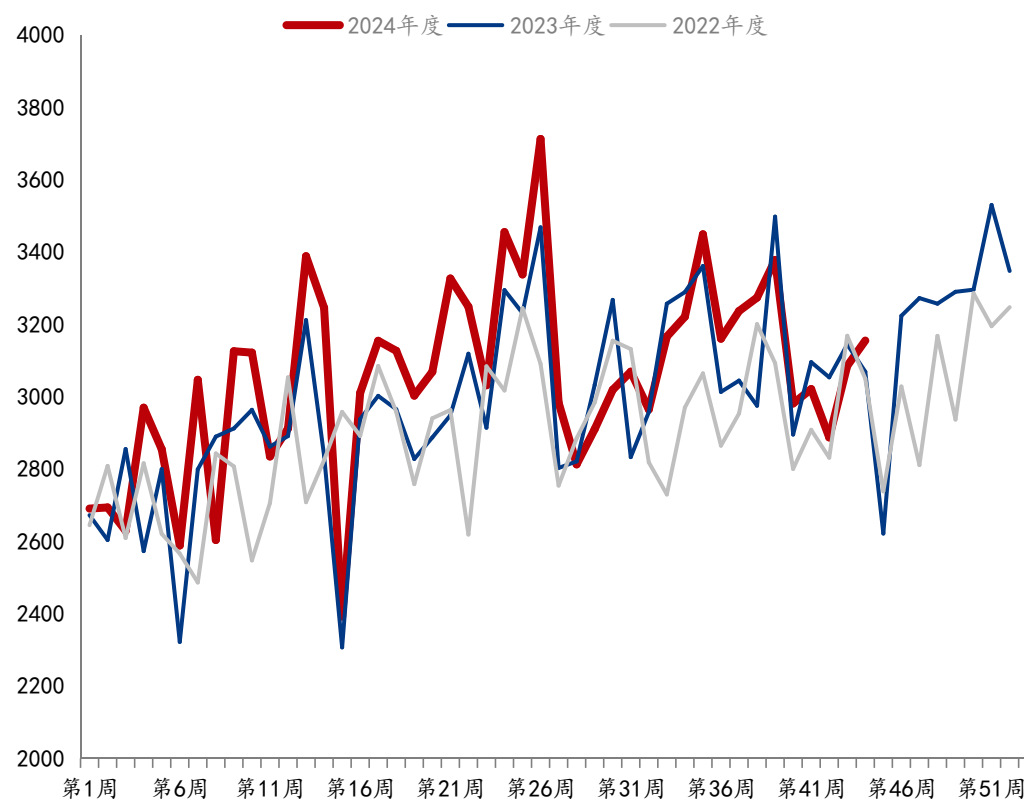
■ 本周策略建议

市场情绪短期偏空，铁矿石主力2501合约预期波动区间720-840，关注780-800区间压力。

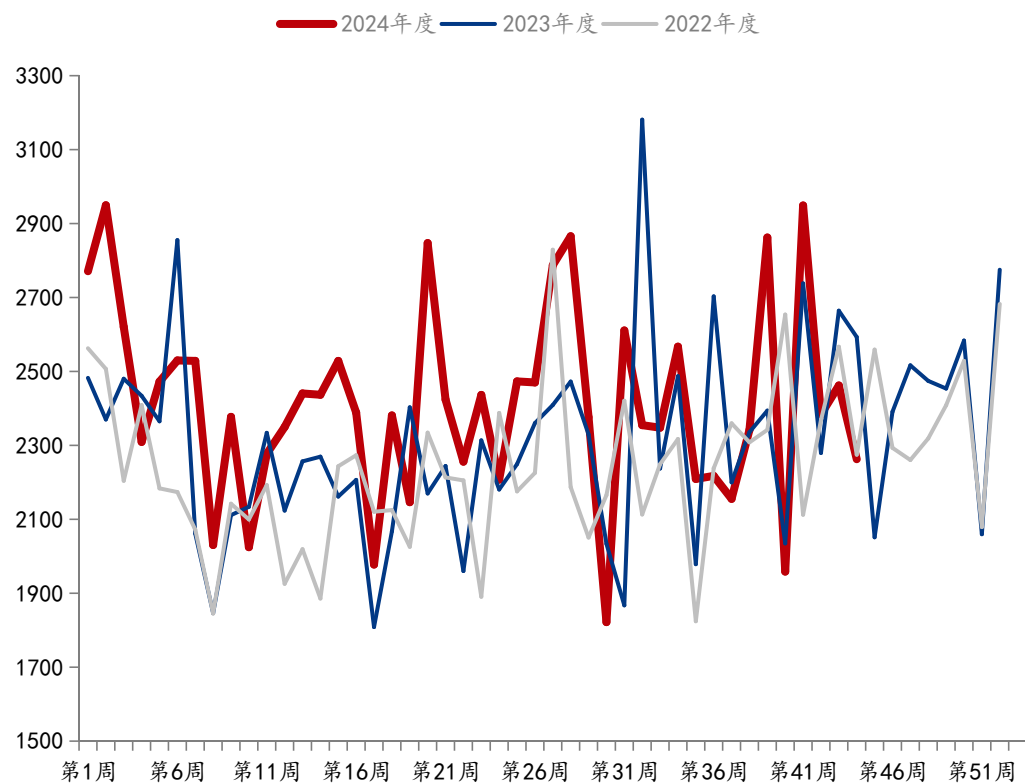
国内186家矿山企业产能利用率



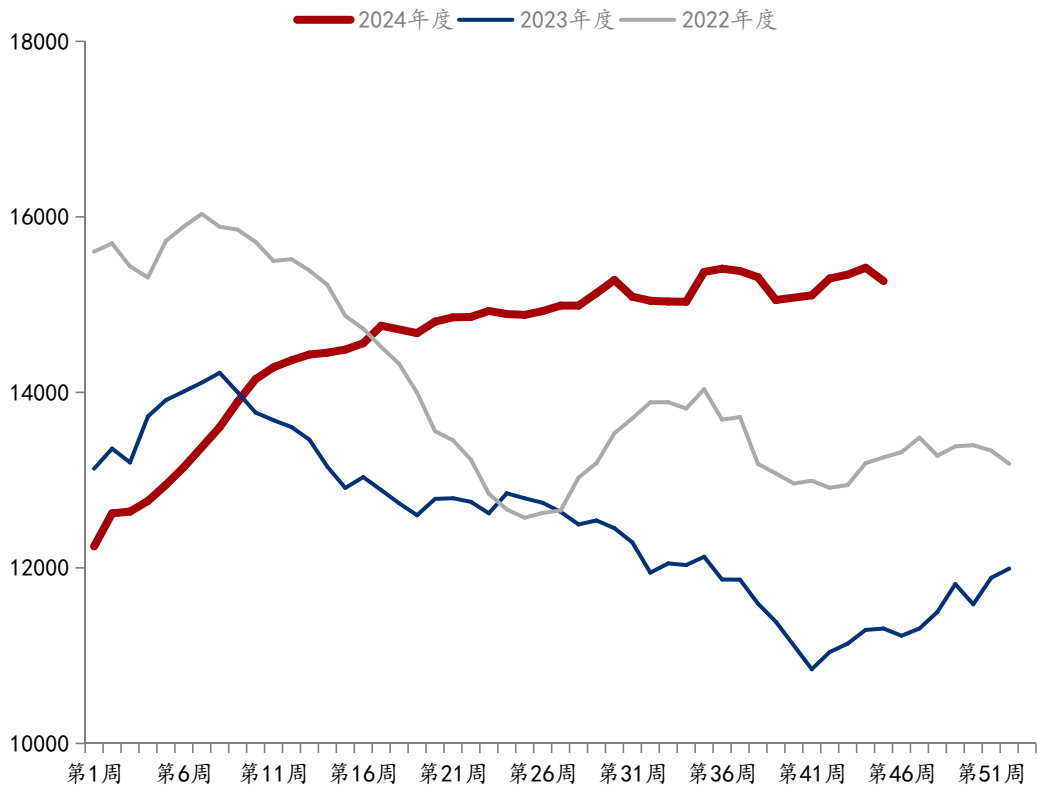
全球铁矿石发货量



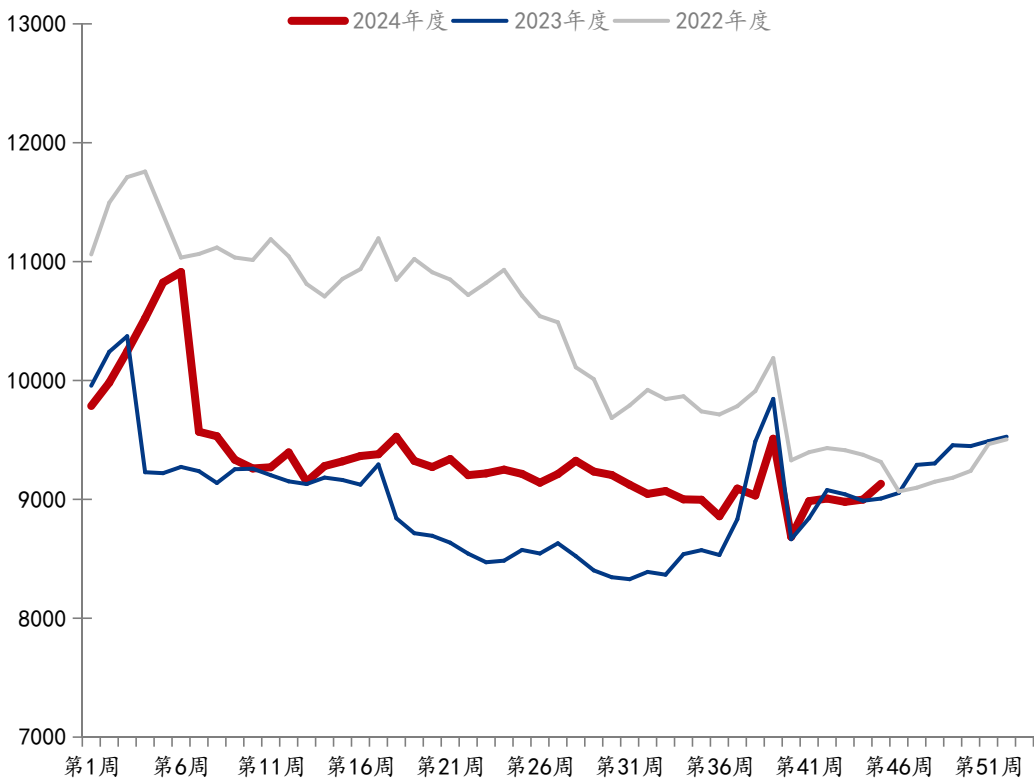
国内45个港口铁矿石到港量



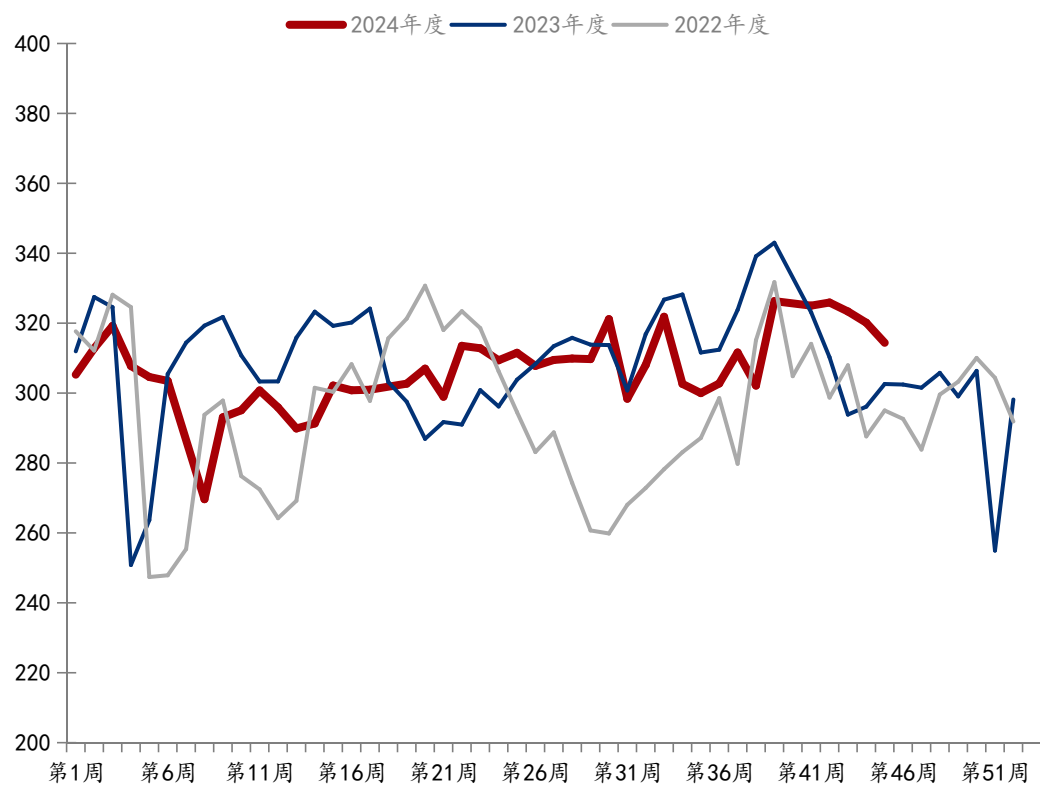
国内45个港口进口铁矿石库存



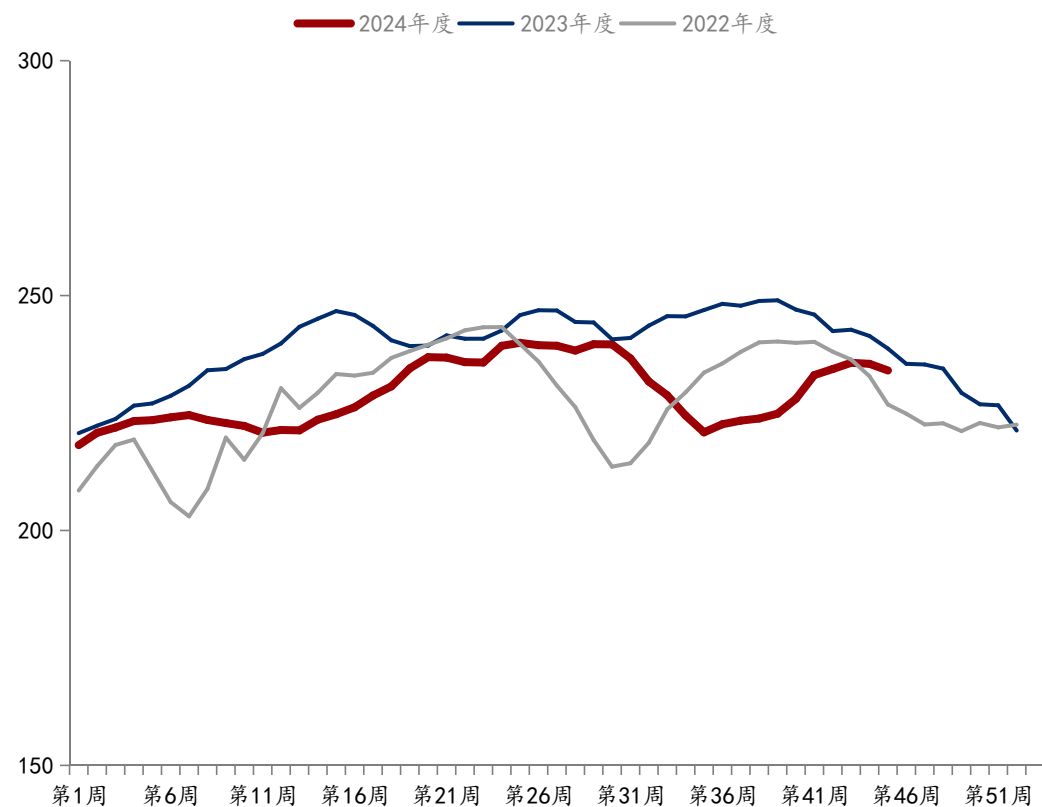
国内247家钢铁企业进口铁矿石库存



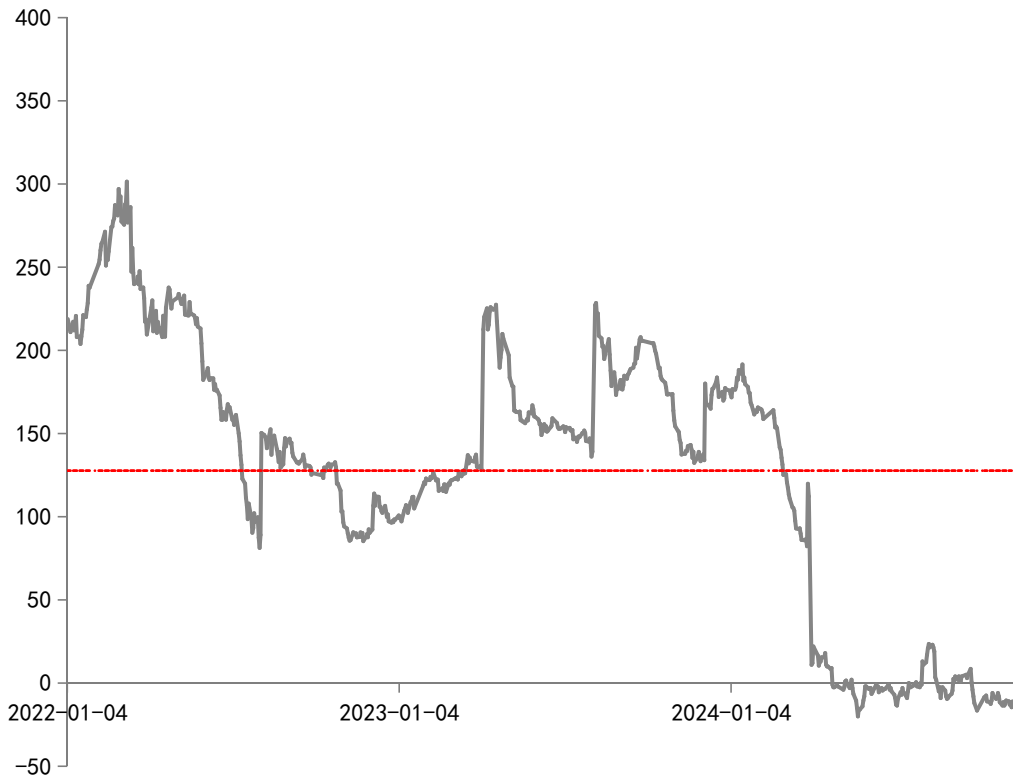
国内45个港口铁矿石日均疏港量



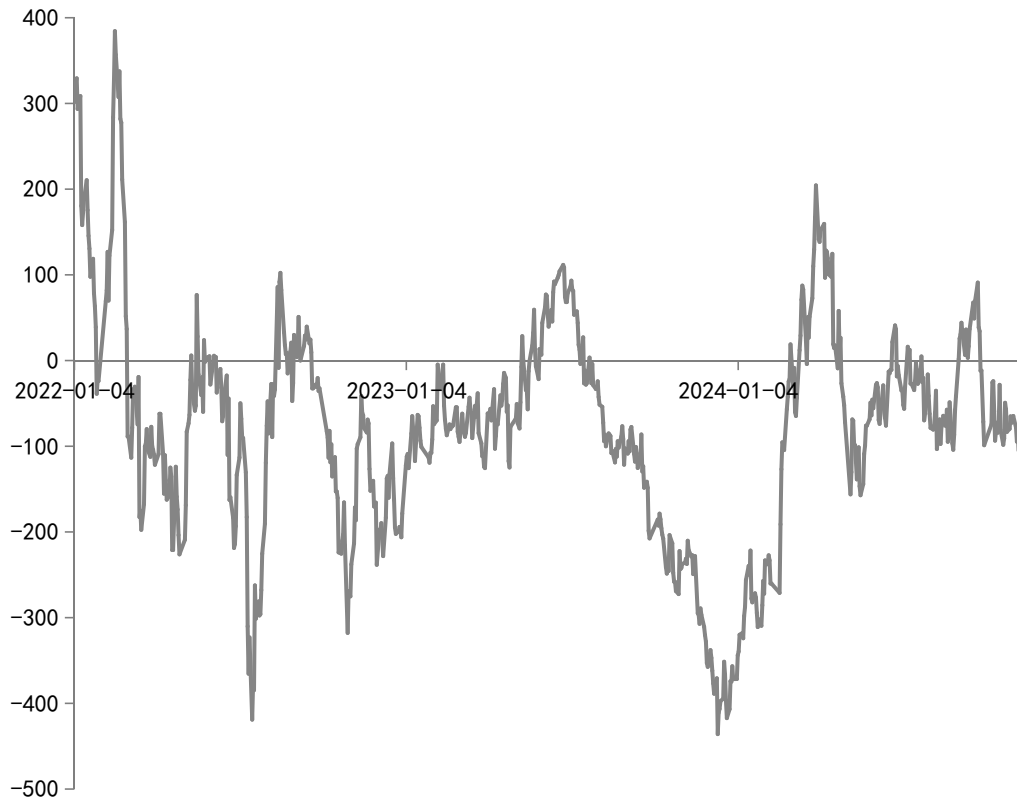
国内247家钢铁企业日均铁水产量



铁矿石期现基差



江苏地区铁废价差





铁矿石(i) ▾

品种诊断

机构观点

盈利席位

主力资金 ⋮

- AI品种诊断报告 -

看整体趋势，日线处在横盘阶段，根据近年来行情周期的规律，当前可能处于行情开始阶段。

资金方面，主力偏空态度较为明显。同时，资金流入幅度较大，主力关注度上升。



铁矿石(i) ▾

品种诊断

机构观点

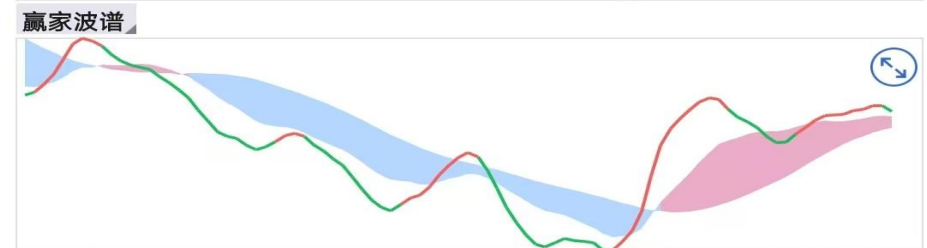
盈利席位

主力资金 ⋮

多空流向: -77.4    主力较为偏空资金能量: 53.8    资金流入幅度较大多空分歧: 16.4    变盘风险低



分时 日K 1m 5m 30m ...



分时 日K 1m 5m 30m ...



本报告蕴含信息均来自于公开资料，我对报告中的信息、数据及观点的准确性、可靠性、完整性及时效性不作任何保证，不构成任何投资咨询建议，据此入市，风险自担，与本公司和作者无关。

本报告版权归长城期货所有，未经长城期货书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“长城期货”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。

交易咨询业务资格：广东证监许可〔2023〕1号
曾永泰 从业资格：F0276476 投资咨询：Z0003143

长城期货股份有限公司提醒广大投资者：期市有风险，入市需谨慎！



长城期货
GREAT WALL FUTURES

谢谢

感谢您的观看

本报告中所有观点仅供参考，请务必阅读本报告倒数第二页的免责声明。