

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

一. 行业新闻

钢材

中国 9 月 PPI 同比 3.6%，为 5 个月新低，预期 3.6%，前值 4.1%。
中国 9 月 PPI 环比 0.6%，前值 0.4%。

10 月 16 日，陕西省出台打赢蓝天保卫战新《方案》对冲研投讯，据陕西日报，陕西省日前发布了《陕西省铁腕治霾打赢蓝天保卫战三年行动方案（2018—2020 年）（修订版）》。新《方案》提出到 2020 年，全省设区市优良天数比率和 PM2.5 浓度完成国家下达目标，重度及以上污染天数比率较 2015 年下降 25%以上，PM10 浓度明显下降。在调整优化产业结构上，陕西省提出未来三年，关中核心防治区域禁止新建、扩建燃煤发电、燃煤热电联产和燃煤集中供热项目，禁止新建、扩建和改建石油化工、煤化工项目。

10 月 16 日，进博会对苏州区域限产的影响跟踪，据 Mysteel 跟踪了解到，常熟地区：常熟龙腾特钢计划于 11 月初对一座 1080m³ 高炉进行检修，预计日均影响铁水产量 4000 吨；同时一条棒材线配套检修 20 天，预计影响棒材产量 5 万吨；一条工业线配套检修 10 天，预计影响工业线材产量 1 万吨。张家港地区：沙钢、永钢均已收到政府相关限产文件，其中永钢确认执行限产 50%的相关政策，预计日均影响粗钢产量 1.14 万吨，预计 11.1 日开始执行，为期一个月。沙钢方面目前尚在制定相关限产措施，具体的文件尚未对外发布。

10 月 16 日，柳钢一号热轧生产线于 2018 年 10 月 15 日进行常规检修，具体复产时间未定，日均影响产量 0.8 万吨。

铁矿石

10 月 16 日，15 日普氏 62%进口矿指数 71.25，跌 0.25，月平均 70.3；钢铁 TSI62%指数 71.25，跌 0.25，月平均 70.3。

10 月 16 日，力拓：受检修和安全事故影响第三季铁矿石发货量下降约 5% 结束四连增。

10 月 16 日，巴西淡水河谷第三季的铁矿石产量达到纪录高位，受其位于帕拉州的 S11D 项目产量增加的提振。提交的监管文件显示，淡水河谷第三季的铁矿石产量同比跳增 10.3%，达到 1.04945 亿吨，球团矿产量同比提高 8.7%至 1,387.8 万吨。铁矿石销量亦触及 8400 万吨的新高。



中融汇信期货

徐懌臻

期货从业资格号：F3041728

投资咨询资格号：Z0013801

微信公众号：



联系方式：021-51557562

邮箱：xulili@zrhxqh.com

网址：http://zrhxqh.com/

地址：上海市浦东新区源深路

1088 号平安财富大厦 25 楼



钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

10/16, 螺纹开盘 4160, 盘中最低 4105, 尾盘报收 4117; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4610 元/吨; 天津: 4410 元/吨, 相比上交易日 0/+20, 基差 493, 偏高, 期货下跌致期货贴水轻微扩大, 唐山钢坯 3920 元/吨, 与昨日+30; 盘面利润(理论) 824.69, 偏高; 16 日, 受上海进博会限产影响, 沙钢、永钢均已收到相关限产文件, 其中永钢确认执行限产 50% 的相关政策, 沙钢尚未对外发布, 提振盘面价格; 南北螺纹现货稳定; 前期环保预期放松现转紧叠加现货维持, 支撑反弹, 但后期需求转淡, 反弹高度或有限, 盘面高位震荡; 铁矿石今日下跌报收 507.5, 现货 pb 粉(湿基): 547 (+3); 六大港口到港总量为 1096.5 万吨(+233.3), 增幅较大, 日均疏港总量 289.97, 处于高位, 库存为 14353.18 (-147.8); 疏港量高位, 现货微涨, 支撑价格。

操作建议: 目前利润 800 附近, 螺纹高位震荡, 4200 承压, 短线区间操作, 注意控制风险。铁矿石 480 支撑, 震荡偏强, 短线区间操作, 注意控制风险。

三. 基本面数据

品种	区域	现货价格	涨跌	收盘	涨跌	基差
螺纹	上海	4610	0			
	天津	4410	20			
	螺纹01-05	320		4117	-33	493
	盘面利润	824.69				
	现货模拟利润	1317.69				
热卷	上海	4450	-40			
	天津	4270	-50	3947	-21	503
	热卷01-05	225				
钢坯	唐山	3920	30			
铁矿pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	547	3	507.5	-1.5	39.5
	铁矿09-01	2				
二级焦炭	唐山	2365	50	2448.5	-28.5	-83.5

免责声明

本报告所载的内容仅作参考之用, 不作为或被视为出售或购买期货品种的要约或发出的要约邀请。此报告的内容不构成对任何人的投资建议, 而中融汇信不会因接收人收到此报告而视他们为其客户。本报告中的信息均来源于公开可获得资料, 中融汇信力求准确可靠, 但对信息的准确性及完整性不做任何保证。客户应谨慎考虑本报告中的任何意见和建议, 不能依赖此报告以取代自己的独立判断, 而中融汇信不对因使用此报告而引起的损失负任何责任。本报告仅反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。本报告所载的观点不代表中融汇信期货有限公司的立场。中融汇信可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。未经中融汇信授权许可, 任何引用、转载以及向第三方传播的行为均可能承担法律责任。