

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report



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



一. 行业新闻

钢材

11月13日, 据河北省冶金行业协会最新数据, 1-9月份, 河北省钢铁行业主营收入完成8651.72亿元, 同比增长12.87%, 占全省工业主营业务收入的28.73%; 完成利润713.51亿元, 同比增长54.95%, 占全省工业利润的37.73%。1-9月份, 河北省钢铁行业主营业务收入利润率为8.25%, 同比提高2.24个百分点, 其中9月份河北省钢铁行业主营业务收入利润率为7.68%。1-9月份吨钢利润406.00元, 其中9月份为399.78元。

11月13日, 京津冀及周边和汾渭平原将出现大气重污染过程, 据生态环境部微信公众号消息, 生态环境部11月12日向媒体通报, 11月13日至15日, 京津冀及周边地区和汾渭平原将出现一次区域性大气重污染过程。通报称, 根据中国环境监测总站最新预测预报结果, 11月13日至15日, 京津冀及周边地区和汾渭平原受不利气象条件影响, 近地面以弱南风为主, 湿度较大, 大气扩散条件差, 污染物逐步积累, 北京、天津、河北省中南部、山西省东部和南部、山东省西部、河南省北部以及关中地区部分城市空气质量将连续2至3天达到重度污染, 个别城市可能出现严重污染。

11月13日, 起沙钢废钢价格下调50, 各废钢供货单位: 沙钢自2018年11月13日起废钢价格下调50元/吨, 具体废钢价格以2018-F30价格为准。

环保回头看, 钢厂自查自纠, 山西GY高炉焖炉3-5天。

铁矿石

11月12日, 普氏62%铁矿石指数报76.75美元/吨, 较前一交易日下跌0.50美元/吨, 跌幅0.65%, 止步两连涨。

11月13日, 澳大利亚皮尔巴拉港务局数据显示, 10月黑德兰港口铁矿石出口总量为4017万吨, 环比减少下降7.7%, 同比下降2.0%。其中出口到中国的铁矿石总量达3278万吨, 环比下降12.3%。

11月13日, 俄钢企Severstal加大投资以提高铁矿石自给能力。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

11/13, 螺纹开盘 3850, 盘中最低 3835, 尾盘报收 3868; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4480 元/吨; 天津: 4380 元/吨, 相比上交易日-20/-30, 基差 612, 偏高, 期货上涨致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3680 元/吨, 与前日-120; 盘面利润(理论) 379, 收窄; 环保回头看, 山西部分钢厂焖炉 3-5 天, 京津冀和汾渭地区出现大气重污染, 生产或受到影响, 但产量同比较高; 钢厂利润快速收窄, 废钢价格下降; 北材南下发货同比较高, 成交降温, 钢坯快速下跌 120, 厂库出现垒库, 盘面高位震荡偏弱; 铁矿石今日下跌报收 511.0, 现货 pb 粉(湿基): 587 (-5); 黑德兰港口铁矿石出口总量为 4017 万吨(-4351), 日均疏港量: 296.2 (-11.63), 库存: 14281.57 (-75.53), 低品矿库存下降较快; 疏港量依旧偏高, 库存下降, 支撑价格, 但钢厂采购低品矿意愿增加。

操作建议: 目前利润回落 400 附近, 螺纹高位震荡, 偏弱, 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	4480	-20			
	天津	4380	-30			
螺纹01-05		379		3868	20	612
盘面利润		364.46				
现货模拟利润		976.46				
热卷	上海	4040	-40			
	天津	3960	-50	3611	6	429
热卷01-05		190				
钢坯	唐山	3680	-120			
铁矿pb(湿基)华北(曹妃甸)		587	-5	511	-9	76
	铁矿09-01	24				
二级焦炭	唐山	2615	0	2300.5	-2.5	314.5

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。