

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

1月8日，长治市政府决定在重污染期间实施重污染天气应对十项措施，有关煤焦钢的具体措施如下：全市所有钢铁企业在确保安全生产的前提下停产，有供热任务的报请市场政府同意后，由经信部门现场核实后确定停限产比例；

1月8日，从河北省生态环境厅获悉，2019年河北省将压减钢铁产能1400万吨、煤炭900万吨、水泥100万吨、平板玻璃660万重量箱、焦炭300万吨，淘汰火电50万千瓦（或调整为应急电源）任务。以钢铁、水泥、平板玻璃、焦化、化工、制药等行业为重点，完成7家重点污染工业企业搬迁改造和关闭退出，对逾期未完成退城搬迁的企业予以停产。

1月8日，上周（12月31日至1月6日）全国食用农产品市场价格比前一周上涨0.2%，生产资料市场价格比前一周下降1.1%。生产资料市场：钢材价格下降0.7%，其中螺纹钢、高速线材、热轧带钢价格分别为每吨4039元、4105元、4109元，分别下降0.8%、0.7%和0.7%。煤炭价格下降0.1%，其中动力煤价格为每吨604元，下降0.2%，无烟煤价格为每吨892元，上涨0.1%，炼焦煤价格为每吨774元，保持平稳。

1月8日，唐山象屿正丰总库存6.3万吨，其中钢坯库存4.7万吨。另外1月7日早八点到1月8日早八点，总入库量为0.18万吨，其中钢坯0.11万吨，总出库量0.59万吨，其中钢坯0.43万吨。

铁矿石

1月7日，普氏62%铁矿石指数报74.95美元/吨，较前一交易日上涨1.50美元/吨，涨幅2.04%，连续三个交易日上涨。

1月8日，巴西CanaadosCarajas地区的S11DEliezer铁矿石项目产量达预期。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

1/8, 螺纹开盘 3521, 盘中最低 3483, 尾盘报收 3505; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3810 元/吨; 天津: 3710 元/吨, 相比上交易日持平, 基差 305, 偏高, 期货下跌致期货贴水轻微扩大, 唐山钢坯 3360 元/吨, 与昨日+60, 盘面利润(理论) 408.61; 2019 年河北省将压减钢铁产能 1400 万吨, 长治市污染预警停/限产, 螺纹实际产量或继续小幅下降; 钢铁价格下降 0.7%, 唐山象屿总库存 6.3 万吨; 基建加码, 需求预期转强, 行业内产量环比小幅减少, 冬储意愿偏低, 厂/社库持续双垒, 盘面窄幅震荡; 铁矿石上涨至 514.0, 现货 pb 粉(湿基): 568 (+4); 全国到港总量为 1974.5 万吨 (-354), 日均疏港量下降 264.03 万吨 (-1.20), 处高位, 库存温和垒库; 发货量持续减少, 日均疏港量高位, 现货上涨, 盘面宽幅震荡, 偏强。

操作建议: 目前利润 400 附近, 螺纹盘面窄幅震荡, 短线区间操作, 或择机逢低正套 05-10, 注意控制风险。铁矿石宽幅震荡, 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	3810	0			
	天津	3710	0			
螺纹05-10		225		3505	-15	305
盘面利润		408.61				
现货模拟利润		713.61				
热卷	上海	3870	-40			
	天津	3780	-50	3403	-8	467
热卷05-10		181				
钢坯	唐山	3360	60			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	568	4	514	-0.5	54
铁矿05-09		28.5				
二级焦炭	唐山	1980	-85	2170	30	-190

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。