

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 15 日, 钢铁产业吹响结构优化号角, 据经济参考报, 14 日, 中国钢铁工业协会召开 2019 理事(扩大)会议, 中国钢铁工业协会会长于勇表示, 经过 3 年的努力, 全国化解钢铁过剩产能 1.5 亿吨, 提前完成此前 5 年化解过剩产能 1 亿至 1.5 亿吨的上限目标。在此背景下, 于勇指出, 2019 年钢铁行业供给侧结构性改革重点将从化解过剩产能转向防范已化解产能复产, 从产能总量调整转向产能结构优化、布局调整和兼并重组。

1 月 15 日, 晋钢冬储政策通知如下: 1. 锁价模式, 大螺纹基价 3670 元, 盘螺基价 3800 元。2. 保值模式, 大螺纹基价 3720 元, 盘螺基价 3850 元, 保值时间至 3 月 15 日。比较价为 2 月 25 日, 3 月 5 日, 3 月 15 日三日均价。如均价比保值价低按均价结算, 如均价比保值价高按保值价结算。均价定价标准为河南一线钢厂网价下浮 100 元/吨。所有货物 3 月 15 日之前须提完。

1 月 15 日, 涟钢计划 2 月份对一座 2800m³ 高炉进行检修, 影响铁水约 10 万吨左右, 具体执行时间视行情而定。

铁矿石

1 月 15 日, 普氏 62% 铁矿石指数报 74.80 美元/吨, 较前一交易日上涨 0.10 美元/吨, 涨幅 0.13%, 连续三日上涨。

1 月 15 日, 矿业巨头力拓: 受兰伯特角港失火影响部分铁矿石发运受限

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

1/15, 螺纹开盘 3576, 盘中最低 3508, 尾盘报收 3519; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3750 元/吨; 天津: 3770 元/吨, 相比上交易日-20/+10, 基差 231, 中性, 期货下跌致期货贴水持续扩大, 唐山钢坯 3410 元/吨, 与前日+10, 盘面利润(理论) 433.14; 中钢协钢铁行业从化解过剩产能到结构优化兼并重组; 涟钢计划 2 月份对一座 2800m³ 高炉进行检修, 影响铁水约 10 万吨左右, 但产量变幅趋缓; 晋钢冬储锁价模式, 大螺纹基价 3670 元; 产量小幅变动, 弱冬储下, 现货维持, 盘面窄幅震荡; 铁矿石上涨至 512.0, 现货 pb 粉(湿基): 564; 全国到港总量下降, 港口累计成交 90.90 万吨, 上周 117.27 万吨, 库存为 14182.20 (-105.96); 到港量减少, 成交转弱, 库存去化, 现货维持, 盘面宽幅震荡。

操作建议: 目前利润 450 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, 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	3750	-20			
	天津	3770	10			
螺纹05-10		181		3519	-56	231
盘面利润		433.14				
现货模拟利润		664.14				
热卷	上海	3800	-40			
	天津	3770	-50	3416	-43	384
热卷05-10		143				
钢坯	唐山	3410	0			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	564	0	512	-1	52
铁矿05-09		26.5				
二级焦炭	唐山	1965	0	2019	4	-54

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。