

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

一. 行业新闻

钢材

2 月 20 日,《北京市污染防治攻坚战 2019 年行动计划》(京政办发〔2019〕5 号)正式发布。“行动计划”对蓝天、碧水、净土三大保卫战的 2019 年任务措施进行了总体布局,旨在统筹生态环境系统保护,全面推进生态环境精治、法治、共治。2019 年空气质量目标任务为“本市细颗粒物(PM_{2.5})年均浓度、三年滑动平均浓度力争继续下降。”

2 月 19 日,据大汉物流监测本周钢铁库存数据显示,本周中西南地区社会库存 863.8 万吨,周环比增加 22.8%,增幅收窄近 30%。七城样本仓库建材出货环比增长 182.3%,主要是因为春节第一周工地大部份仍处在停工状态,第二周即本周开始,基建和工地小部分开工。

2 月 20 日,据中钢协统计数据显示,2019 年 1 月下旬重点钢企粗钢日均产量为 181.72 万吨,旬环比增加 1.00 万吨,增长 0.55%。截至 2019 年 1 月下旬末,重点钢铁企业钢材库存量为 1074.17 万吨,旬环比减少 125.74 万吨,降幅为 10.48%。

2 月 20 日,2019 年中天 2-3 期计划量,螺纹、线材和盘螺全折;永钢 2-3 期计划量,螺纹 6.5 折,线材和盘螺全折;沙钢对 2 月份螺纹计划量全折。

铁矿石

2 月 19 日,据钢联,巴西当地时间 2 月 18 日,巴西国家矿业机构发布决议宣布将禁止在全国范围内使用上游式尾矿坝。

2 月 19 日,本周到港量数据如下:全国 26 港到港总量为 2078.3 万吨,环比增加 251.2 万吨;北方六港到港总量为 1089.3 万吨,环比增加 273.3 万吨;全国 26 港主流高品澳粉到港 416.0 万吨,环比增加 0.1 万吨,主流低品澳粉到港 243.8 万吨,环比增加 191.0 万吨,主流澳块到港 247.7 万

2 月 19 日,随着铁矿石价格的上涨以及巴西尾矿坝事件的升级,西澳矿企 Venture Minerals 将在西海岸启动新的铁矿石项目,该项目有机会在相对较短的时间内投产。

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: 021-51557597

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

2/20, 螺纹开盘 3650, 盘中最低 3578, 尾盘报收 3641; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3790 元/吨; 天津: 3830 元/吨, 相比上交易日-30/-10, 基差 119, 中性, 现货下跌致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3400 元/吨, 与前日持平, 盘面利润(理论) 328.5; 环保近期升温, 山东省部分地区启动橙色预警, 要求工业企业按照“一厂一策”, 错峰生产减排, 临汾市按照惯例可能限产 30%; 环保扰动产量, 产量小幅下降, 但受节假日影响采螺量下降至 1860 (-87.87%), 按照目前 14.22% 的增幅后期库存压力偏大, 目前盘面震荡上行转弱, 重点关注后续需求; 铁矿石上涨至 619.5, 现货 pb 粉(湿基): 650 (-1); 北方六港到港总量为 1089.3 万吨(+273.3), 铁矿累计成交 53.50 万吨(-7.76%), 钢厂采购受矿价大幅上涨影响观望为主; 铁矿减产预期再次上升, 供应偏紧或成主导, 短期内对盘面影响极大, 盘面高位震荡。

操作建议: 目前利润回落至 350 附近, 螺纹盘面震荡上行转弱, 短线区间操作, 或择机逢低正套 05-10 (193), 注意控制风险。铁矿石受淡水河谷尾矿坝泄漏影响, 高位震荡, 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	3760	-30			
	天津	3820	-10			
	螺纹05-10	193		3641	-14	119
	盘面利润	328.5				
	现货模拟利润	447.5				
热卷	上海	3930	-40			
	天津	3870	-50	3657	19	273
	热卷05-10	198				
钢坯	唐山	3400	0			
铁矿pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	650	1	619.5	-11.5	30.5
	铁矿05-09	34				
二级焦炭	唐山	2065	0	2113	28	-48

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。