

# 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

## 一. 行业新闻

### 钢材

2 月 27 日, 2018 年河南省钢材产量及增长情况分析, 2018 年 1-3 季度河南省钢材产量呈增长趋势, 增长幅度有所减缓; 2018 年 4 季度河南省钢材产量回落, 2018 年 12 月河南省钢材产量为 274.63 万吨, 同比下降 8.78%。2018 年河南省钢材产量为 3757.84 万吨, 同比下降 13.39%。

2 月 27 日, 1 月份, 天津市不锈钢材市场交易量、额环比双降。统计数据显示, 1 月份, 天津市不锈钢材交易量为 4820 吨, 环比下降 2.6%; 交易额为 7200 万元, 环比下降 3.5%。

2 月 27 日, 方大特钢轧钢厂棒材线再次刷新生产纪录, 继方大特钢轧钢厂 2 月 24 日打破日产纪录, 同日再破三条生产线的线日产纪录后, 2 月 25 日轧钢厂棒材线又以 5031.7 吨, 再次刷新该线日产纪录。

2 月 27 日, 钢谷网统计的 31 家流通商建材成交量总计 21801.960 吨, 环比上周二增 136.96%, 较上一交易日减 4.98%, 较 1 月成交均值增 175.41%。

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

### 铁矿石

2 月 27 日, 澳洲最大的钢铁制造商博思格钢铁公 CEO Mark Vassella 表示, 公司钢厂公司位于肯布拉港 (Port Kembla), 为满足其低成本铁矿需求, 公司一直在扩展海外市场

2 月 27 日, 新加坡市场铁矿石期货跌破 80 美元/吨, 跌 0.7%。

2 月 27 日, 力拓上一财年基础利润是 88.1 亿美元, 预期为 85.4 亿美元。



# 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

## 二. 行情分析

2/27, 螺纹开盘 3737, 盘中最低 3697, 尾盘报收 3715; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3820 元/吨; 天津: 3840 元/吨, 相比上交易日+10/+0, 基差 105, 偏小, 期货下跌致期货贴水轻微扩大, 唐山钢坯 3470 元/吨, 与前日+10, 盘面利润(理论) 472.37; 方大特钢轧钢厂棒材线以 5031.7 吨再次刷新生产纪录, 2 月上旬全国重点钢铁企业粗钢日均产量 192.19 万吨, 较上一旬增长 5.76%; 产量小幅增加叠加雨水天气延迟开工, 库存快速累积, 按照目前 15.27% 的增幅, 今年库存高点大概率超过去年, 后期库存压力偏大, 一些钢贸企业的库存水平在 50% 左右, 且业内认为今年钢材需求释放比去年更晚, 目前盘面震荡回调, 重点关注后续需求; 铁矿石下跌至 593.0, 现货 pb 粉(湿基): 612 (-12); 力拓上一财年基础利润是 88.1 亿美元, 预期为 85.4 亿美元, 澳/巴发货总量环比增加, 钢厂利润偏高, 采购意愿持续增加, 日均疏港总量超 280, 处高位, 库存小幅增加; 钢厂产量平稳, 对铁矿需求端存在支撑; 淡水河谷矿难事件暂无进一步进展, 铁矿价格弱势跟随。

操作建议: 目前利润回落至 470 附近, 螺纹盘面震荡回调, 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       | 3820   | 10  |      |       |     |
|           | 天津       | 3840   | 0   |      |       |     |
|           | 螺纹05-10  | 193    |     | 3715 | -21   | 105 |
|           | 盘面利润     | 472.37 |     |      |       |     |
|           | 现货模拟利润   | 577.37 |     |      |       |     |
| 热卷        | 上海       | 3970   | -40 |      |       |     |
|           | 天津       | 3910   | -50 | 3734 | -10   | 236 |
|           | 热卷05-10  | 213    |     |      |       |     |
| 钢坯        | 唐山       | 3470   | 10  |      |       |     |
| 铁矿pb (湿基) | 华北 (曹妃甸) | 612    | -12 | 593  | -0.5  | 19  |
|           | 铁矿05-09  | 36.5   |     |      |       |     |
| 二级焦炭      | 唐山       | 2065   | 0   | 2122 | -21.5 | -57 |

## 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。