

# 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: 021-51557597

邮箱: xulili@zrhxqh.com

网址: <http://zrhxqh.com/>地址: 中国(上海)自由贸易试验区  
东育路255弄5号29层

## 一. 行业新闻

### 钢材

4月8日,永钢4月中旬螺纹8折(上期6折),盘螺7.5折(上期7折)。

4月8日,据中商产业研究院数据库显示,2018年1-3季度湖南省钢材产量呈小幅度增长,2018年4季度湖南省钢材产量回落;2019年1-2月湖南省钢材产量为379.08万吨,同比增长8.85%。

4月8日,临汾限产延期至11,19座钢厂高炉受影响,现临汾区域有正常流通资源钢厂7家,其中酒钢翼城已经申请破产。在有正常流通资源的钢厂中,本次停限产实际影响到6家钢厂,高炉总计为19座,总容积为12080m<sup>3</sup>;所有钢种轧线总计为32条,所有轧材产线日产量约在4.75万吨左右。

### 铁矿石

4月8日,普氏62%铁矿石指数报92.90美元/吨,较前一交易日持平。

4月8日,自然资源部消息,一季度,巴西淡水河谷公司在帕拉州的S11D铁矿出口量为1590万吨,较去年同期的1130万吨增长41%。出口额为7.98亿美元,较去年同期的5.66亿美元增长41%。2018年,S11D铁矿出口量为5940万吨,出口额为28.7亿美元。该矿2016年12月份投产,2017年1月出口量2.65万吨。2018年5月,淡水河谷公司预测S11D铁矿2019年产量为7000~8000万吨,2020年产量9000万吨。2018年12月,淡水河谷证实将投资7.7亿美元对S11D铁矿进行扩产。计划到2022年产量达到1亿吨。

# 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

## 二. 行情分析

4/8, 螺纹 1910 开盘 3614, 盘中最低 3613, 尾盘报收 3730; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4050 元/吨; 天津: 4050 元/吨, 相比上交易日+90/+40, 基差 320, 期货上涨致期货贴水收窄, 唐山钢坯 3510 元/吨, 与昨日+60, 盘面利润(理论) 582.97; 唐山市重点行业 2019 年第二至第三季度错峰生产方案 4-9 月限产来袭, 按照去年同期情况预计 5 月起影响较大, 今年相对前两年对长流程产钢的依赖度下降, 电炉产能不断增加, 螺纹周产量 330.69 万吨, 较上周增加 5.57 万吨, 产量环比继续有较大幅度增加; 螺纹社库 872.28, 环比减少 44.66 万吨, 厂库 246.55 万吨, 环比减少 8.79 万吨, 厂/社双降, 且去化加速, 周度消费创历史新高, 当前市场整体需求仍维持旺季水平, 但产量恢复明显快于去年同期, 且后期依然有释放空间, 高产量仍是多头的隐患, 且目前实际需求没有问题, 但随着下游工地工期进度和消耗下降, 就会带来成交量下滑, 采购缩量会蔓延到现货价格下跌; 综上, 目前外矿供应缩减致矿价大幅反弹带动黑色整体偏强运行, 短期受成本以及现货支撑, 盘面偏强运行; 铁矿石上涨至 653.5, 现货 pb 粉(湿基): 654(+11); 热带低地(这次被命名为华莱士)正在阿拉弗拉海上进行组织, 下周二影响黑德兰港的强风强度较先前预测有所增加, 预计强度为 9-10 级风, 下周或将对黑德兰港产生重大影响; 淡水河谷依据官方宣布 2019 年铁矿销售量预计在 3.07 亿吨至 3.32 亿吨, 少于市场预期, 利好盘面。日均疏港方面均值 280 附近, 最新: 277.14, 环比下降 15.66, 但依旧处于高位, 因青岛与沿江港口转水量下降; 行业内, 钢厂采购偏向积极, 港口铁矿石库存为 14843.43 万吨, 较上周增 140.5 万吨; 但盘面受飓风影响, 高位震荡, 偏强。

操作建议: 目前利润 500 附近, 螺纹盘面震荡, 短线区间操作, 逢高平仓正套的 05-10(300), 注意控制风险。铁矿石高位震荡偏强, 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	4050	90			
	天津	4050	40			
	螺纹05-10	300		3730	140	320
	盘面利润	582.97				
现货模拟利润	902.97					
热卷	上海	4080	-40			
	天津	4010	-50	3944	98	136
	热卷05-10	276				
钢坯	唐山	3510	60			
铁矿 pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	654	11	712	24.5	-58
铁矿	05-09	58.5				
二级焦炭	唐山	1850	0	2048.5	22	-198.5

## 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

## 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

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。