

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 17 日, 安徽开展钢铁企业煤气安全专项治理自查自改阶段(5 月至 7 月)。钢铁企业要按照此次专项治理的主要内容和《工贸行业重大生产安全事故隐患判定标准(2017 版)》, 认真开展自查自改。对自查中发现的重大安全隐患, 要建立问题、责任、整改“三个清单”, 切实做到整改责任、措施、资金、时限、预案“五到位”。

4 月 17 日, 国家统计局数据显示, 2019 年一季度粗钢产量增长 9.9%至 2.3107 亿吨, 原铝产量增长 3.9%至 857 万吨, 均创历史新高。

4 月 17 日, 4 月底前, 天津市各区人民政府, 市各相关单位按职责分工要全面摸底排查钢铁、水泥、电解铝、平板玻璃、造纸等行业能耗、环保安全、质量达不到强制性标准的, 属于《产业结构调整指导目录(2011 年本, 2013 年修正)》的落后生产设备数量及产能, 研究提出本地区、本系统 2019 年度淘汰落后产能目标计划。

4 月 17 日, 威钢计划从 4 月 18 日开始对 1#棒材生产线进行检修, 预计检修时间 15 天, 日均影响产量 2000 吨, 在此期间, 部分规格将出现资源紧缺的情况。

铁矿石

4 月 15 日, 普氏 62%铁矿石指数报 95.80 美元/吨, 较前一交易日持平。

4 月 17 日, VALE 官方宣布米纳斯吉拉斯州法院已同意暂停施行关于 Brucutu 矿区关停决定。法院将同意 Brucutu 矿区于文件发布后 72 小时后完全重新运营。Brucutu 矿区铁矿年产量为 3000 万吨。VALE 再次确认 2019 年铁矿石及球团销售量目标在 3.07-3.32 亿吨, 与此前发布销售目标一致。

4 月 17 日, 飓风天气影响产出 5%的缘故, 必和必拓下调当前财年铁矿石产出指引, 下修 2019 财年铁矿石产出指引至 26500-27000 万吨区间(之前预计为 27300-28300 万吨)。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

4/17, 螺纹 1910 开盘 3779, 盘中最低 3757, 尾盘报收 3795; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4130 元/吨; 天津: 4110 元/吨, 相比上交易日-20/+0, 基差 335, 现货下跌致期货贴水扩大, 唐山钢坯 3560 元/吨, 与昨日-20, 盘面利润(理论) 599.81; 临汾市下达非采暖季重点区域差异化生产管控的通知, 钢铁行业实行差异化限产 30-50% 的限产比例, 满足 A 类条件的不予错峰限产, 对达不到 C 类条件的, 实施停产治理; 厂库 206.86 万吨, 周环比减少 21.08 万吨, 螺纹社会库存 767.16 万吨, 周环比减少 51.04 万吨, 厂/社双降, 去化速度可观; 螺纹成交方面上周基本维持在 20 万吨附近, 处高位、线螺采购量: 43670 吨, 环比增加 7920; 受钢材现货冲高(有铁矿上涨影响) 叠加下游消耗的增加, 需求进入峰值, 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, 后期若无政策刺激, 需求再出增量是小概率, 峰值之后拐点将至, 盘面震荡运行, 上方空间有限; 铁矿石 09 下跌至 621, 现货 pb 粉(湿基): 662 (-13); 外矿供应偏紧, 内矿产量增加, 需求上, 受到全国多地区复产影响进口矿需求大幅增加, 港口日耗: 289.83 万吨, 其中唐山、山西区域日耗明显增加。但是钢厂库存可用天数还是偏高 30.6 天, 结合钢厂高炉开工率 81.42%, 环比增 1.51%, 增产速度开始放缓, 生铁日均产量有个小幅下滑, 钢厂采购仍较为谨慎, 贸易商抛货兑现利润意愿较大, 盘面震荡。操作建议: 目前利润 600 附近, 螺纹盘面震荡, 短线区间操作, 逢高平仓正套的 05-10 (368), 注意控制风险。铁矿石高位震荡, 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	4130	-20			
	天津	4110	0			
	螺纹05-10	368		3795	19	335
	盘面利润	599.81				
	现货模拟利润	934.81				
热卷	上海	4190	-40			
	天津	4090	-50	3990	18	200
	热卷05-10	271				
钢坯	唐山	3560	0			
铁矿pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	662	-13	691	-6	-29
	铁矿05-09	70				
二级焦炭	唐山	1850	0	2030.5	-6	-180.5

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。