

## 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

### 一. 行业新闻

#### 钢材

5 月 23 日, 广东河源东日钢厂调整: 切粒模具 2420, 生铁 2300-2370, 重废 2370, 钢筋头 2370, 厚剪 2340, 冷轧冲片 2270, 中剪 2220-2280, 小剪 2140-2200, 钢筋压 2330, 角铁压 2150, 中压 1950。

5 月 23 日, 阳春新钢铁 5 月 21 日对 1 座 1250m<sup>3</sup> 高炉开始检修, 预计检修时间 5-6 天, 转炉同步检修, 棒材线全停, 影响成材总量约 4-5 万吨。

5 月 23 日, 衢州元立计划 6 月 1 日-6 月 15 日对小棒线检修 15 天, 预计影响  $\Phi 16-32\text{mm}$  棒材产量 3.5-4 万吨。

#### 铁矿石

5 月 23 日, 自从淡水河谷一处矿场在 1 月份发生致命的溃坝事件后, 新加坡交易所的铁矿石价格已经飙升 37%。作为最大的铁矿石供应商, 淡水河谷的产能在这次的灾难事件后下降了 9300 万吨。总部位于里约热内卢的淡水河谷表示, 要实现其先前的 4 亿吨产量目标需要两到三年时间。

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



# 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

## 二. 行情分析

5/23, 螺纹开盘 3910, 盘中最高 3928, 尾盘报收 3881; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4110 元/吨; 天津: 4090 元/吨, 相比上交易日-10/-20, 基差 229, 期货下跌致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3600 元/吨, 与前日+20, 盘面利润(理论) 421.05; 焦炭三轮提涨落地, 焦炭盘面上涨 5.16%, 受此影响螺纹上涨 3.74%。长流程产量远超与去年同期, 工艺和产能都在高位, 长三角今年产能释放规模大于去年, 短流程产量对利润敏感度强, 成本联动性快, 废钢利用率大幅提升, 而且电炉产能已经修复缺口的同时, 纯废钢电炉仍有利润, 供应水平已在高位, 本周螺纹周产量 381.52 万吨, 较上周增加 3.16 万吨; 螺纹社库 569.83 万吨, 周环比减少 27.86 万吨, 厂库: 204.44 万吨, 周环比减少 10.4 万吨, 去库继续放缓; 目前消费季节性环比下降, 但整体消费韧性强, 受焦炭影响盘面维持高位震荡。铁矿石供应上, 传淡水河谷 Brucutu 矿区将于近期复产, 法院已经批复淡水河谷复产, 复产时间从本周四开始, 但鉴于淡水河谷之前矿难, Brucutu 营业许可时间暂定 3 个月。5 月实际产量甚至超过 4 月, 5 月的限产执行力度不及预期。澳洲巴西发货总量为 2204.4 万吨, 环比上周增 127.7 万吨。对于 6 月, 政策仍是个较为不确定的因素, 预计生铁产量环比减少。

操作建议: 目前利润 400 附近, 螺纹盘面震荡, 短线区间操作, 注意控制风险。铁矿石震荡上行, 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       | 4110   | -10 |       |     |     |
|           | 天津       | 4090   | -20 |       |     |     |
|           | 螺纹05-10  | 295    |     | 3881  | -29 | 229 |
|           | 盘面利润     | 421.05 |     |       |     |     |
|           | 现货模拟利润   | 650.05 |     |       |     |     |
| 热卷        | 上海       | 4220   | -40 |       |     |     |
|           | 天津       | 4060   | -50 | 3725  | -   | 495 |
|           | 热卷05-10  | -3725  |     |       |     |     |
| 钢坯        | 唐山       | 3600   | 20  |       |     |     |
| 铁矿pb (湿基) | 华北 (曹妃甸) | 733    | 13  | 728.5 | 0.5 | 4.5 |
|           | 铁矿05-09  | 60     |     |       |     |     |
| 二级焦炭      | 唐山       | 2050   | 0   | -     | -   | -   |

## 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。