

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

7 月 24 日, 唐山市人民政府发布了《关于 7 月下旬全市大气污染防治加严管控措施的通知》。《通知》表示, 7 月 21 日 0 时至 7 月 31 日 24 时将执行加严管控措施。钢铁行业(含独立球团、高炉铸造)具体情况如下:

一、7 月 21 日 0 时至 7 月 31 日 24 时, 绩效评价为 A 类的首钢迁钢, 沿海临港区域的首钢京唐、文丰钢铁、唐钢中厚板、德龙钢铁、纵横钢铁, 涉搬迁的天柱钢铁、华西钢铁、国义特钢, 停 20% 的烧结机(竖炉)装备。二、7 月 21 日 0 时至 7 月 25 日 24 时、7 月 29 日 0 时至 31 日 24 时, 丰南区、古冶区、开平区、路北区、滦州市、滦南县、迁安市钢铁企业停 70% 的烧结机(竖炉)装备, 丰润区、迁西县、遵化市钢铁企业停 50% 的烧结机(竖炉)装备。

7 月 24 日, 本周钢铁总库存量: 914.29 万吨, 较上周环比增加 35.54 万吨(+4.04%)。包含 38 个城市, 共计 148 个仓库。建筑钢材: 库存总量 544.44 万吨, 较上周环比增加 26.09 万吨(+5.03%)。包含 30 个城市, 共计 85 个仓库。

7 月 24 日, 唐山市相关部门发布了《7 月下旬全市大气污染防治加严管控措施》, 文件进一步加大钢企限产减排措施, 并重点强调 7 月 26 日 0 时至 7 月 28 日 24 时全市钢铁企业烧结机(竖炉)装备全部停产, 高炉休风闷炉。据 Mysteel 跟踪实时调研钢企限产情况, 了解到钢企多积极安排限产事宜, 部分钢企提前开始停产限产。

7 月 24 日, 本周广州 17 家主流仓库螺纹钢 60.92 万吨, 下降 2.67 万吨。线材盘螺 44.28 万吨, 增加 0.1 万吨。目前广州建筑钢材总库存为 105.2 万吨, 较上周下降 2.57 万吨。较去年同期增加 32.57 万吨。

铁矿石

7 月 24 日, 淡水河谷官方宣布, 巴西国家矿业局允许该公司恢复 Vargem Grande 铁矿区干选生产。年初溃坝事件后, 该矿区自 2 月 20 日起全部关停。淡水河谷发文表示, Vargem Grande 矿区干选生产恢复后, 2019 年将增加 500 万吨产量, 由此, 今年巴西混合粉的供应将会增加。生产将在 24 小时之内恢复。

7 月 24 日, 波罗的海干散货运价指数(BDI) 2165 点, 较上个交易日跌 26 点, 跌幅 1.19%。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

7/24, 螺纹开盘 3930, 盘中最低 3878, 尾盘报收 3899; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3950 元/吨; 天津: 3940 元/吨, 相比上交易日-40/-20, 基差 51, 现货下跌至期货贴水收窄, 唐山钢坯 3640 元/吨, 与昨日+0, 盘面利润(理论) 241.75; 唐山市环保再升级《7 月下旬全市大气污染防治加严管控措施的通知》下发, 钢厂按分级限产, 烧结机分别停 20%, 50%, 70%。6 月份粗钢日均产量为 291.77 万吨, 环比增长 1.52%, 再创下历史新高。6 月钢筋产量为 2269.3 万吨, 同比大幅增长 29.4%。消费进入季节性淡季, 但韧性犹存, 现货小幅下跌, 成交转淡, 成本附近有支撑, 但成交开始转淡, 盘面震荡为主。

铁矿石: 淡水河谷官方宣布, 巴西国家矿业局允许该公司恢复 Vargem Grande 铁矿区干选生产。需求方面: 华北: 需求持续低迷, 中低品价差拉大, 由于唐山及武安地区仍在严格执行限产政策, 对铁矿需求锐减, 港口现货成交偏低, 华东: 品种替代性增强, 矿价或小幅回调; 沿江区域市场价格基本呈现粉矿上涨块矿下跌趋势, 市场交投氛围较好。盘面冲高回落, 如前期没有多单持有, 还是以谨慎观望为主。

操作建议: 目前利润 260 附近, 螺纹盘面震荡上行, 短线区间操作, 或择机逢低做多卷螺差, 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	3950	-40			
	天津	3940	-20			
	螺纹 10-01	313		3899	-42	51
	盘面利润	241.75				
	现货模拟利润	292.75				
热卷	上海	4030	-40			
	天津	3970	-50	3827	-	203
钢坯	唐山	3640	0			
铁矿 pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	884	-11	860	-20	24
		124.5				
二级焦炭	唐山	1850	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。