

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

一. 行业新闻

钢材

11月6日,山西省近日印发《关于开展2018-2019年秋冬季大气污染防治综合攻坚行动促进空气质量进一步改善的通知》,要求各市严格落实主体责任。各市人民政府是本地实施大气污染防治工作的责任主体,市长作为第一责任人,对于产业结构优化调整、重污染企业退城搬迁、清洁取暖和散煤替代、柴油货车污染治理等重点任务,要直接负责,亲自协调督办。

河南重点行业11月15日起实施差异化错峰生产,据河南环保厅,11月5日,从河南省污染防治攻坚战办获悉,2018年11月15日至2019年3月15日,河南省钢铁、焦化、铸造、建材、有色、医药(农药)等行业将实施差异化错峰生产。对符合错峰生产豁免条件的,原则上免于错峰,严禁采取“一刀切”方式。

11月6日,《唐山市2018-2019秋冬季钢铁行业错峰生产方案》已经市政府15届17次常务会议审议通过要求各地认真执行,按照规定时间内提前关停的部分炼钢装备的企业,给予政策支持,对于津西减免104.7万吨限产任务,对于港陆减免65万吨限产任务,对于环境敏感区域已经确定实施搬迁的企业,在企业分类和分解错峰限产任务时不在扣减其污染限产绩效评价环境敏感区域分数,并给予秋冬季基准产能15%减免限产任务量的政策支持。根据各钢铁企业超低排放改造工程的实际完成情况,经环保部门或第三方机构进行现场核定确认后,对此方案中各钢铁企业的评价及限产任务进行适当调整。唐山市秋冬季高炉限产产能为2508.26万吨占纳入错峰生产范围高炉产能的42.57%,结合政策鼓励和支持因素计算,全市秋冬季高炉限产产能为1859.22万吨,占秋冬季纳入错峰限产范围高炉产能的31.55%。

铁矿石

11月5日,普氏62%铁矿石指数报75.80美元/吨,较前一交易日上涨1.70美元/吨,涨幅2.29%,止步两连跌。

五矿集团与淡水河谷签署2000万吨铁矿石采购协议。

大连铁矿石期货攀升,因必和必拓暂停西澳洲铁路运输。



中融汇信期货

徐璨璨

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: 021-51557562

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



钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

11/6, 螺纹开盘 4057, 盘中最低 3953, 尾盘报收 3962; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4670 元/吨; 天津: 4580 元/吨, 相比上交易日-20/+0, 基差 708, 偏高, 期货下跌致期货贴水急剧扩大, 唐山钢坯 3910 元/吨, 与昨日-40; 盘面利润(理论) 437.06, 维持高位; 唐山分级错峰生产逐步实施, 其中对于津西、港陆分别减免 104.7 万吨和 65 万吨限产任务, 部分钢企按期搬迁, 支撑盘面价格; 厂/社库双降, 但降幅明显收窄; 北材南下发货同比较高, 且后期成交降温, 厂库降幅收窄, 盘面高位震荡偏弱; 铁矿石今日下跌报收 510.0, 现货 pb 粉(湿基): 587 (+2); 澳铁发货量 1478.4 万吨 (-122.0), 日均疏港量: 307.89 (+3.48), 库存: 14357.4 (-161.24); 发货量下降, 日均疏港量维持高位, 库存下降, 支撑价格, 但唐山地区有污染预警限产, 或影响后续需求。

操作建议: 目前利润 400 附近, 螺纹高位震荡, 偏弱, 短线区间操作, 注意控制风险。铁矿石 480 支撑, 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	4670	-20			
	天津	4580	0			
螺纹01-05		335		3962	-110	708
盘面利润		437.06				
现货模拟利润		1145.06				
热卷	上海	4280	-40			
	天津	4160	-50	3719	-54	561
热卷01-05		176				
钢坯	唐山	3910	-40			
铁矿pb (湿基) 华北 (曹妃甸)		587	2	510	-5.5	77
	铁矿09-01	15.5				
二级焦炭	唐山	2615	-50	2408.5	2.5	206.5

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。