

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

一. 行业新闻

钢材

11月12日,据中新网,前三季度,中国钢铁行业利润增幅超过70%。冶金工业规划研究院院长李新创10日表示,钢铁行业利润水平回升,但去产能的压力仍不小,需警惕扩大产能。中国钢铁工业协会会员钢铁企业实现销售收入3.06万亿元(人民币,下同),同比增长14.47%;实现利税3466.81亿元,同比增长68.20%;实现利润总额2299.63亿元,同比增长86.01%。另外,资产负债率持续下降。9月末,协会会员钢铁企业资产负债率66.11%,同比下降3.91个百分点。的倾向。

11月12日,10月下旬中钢协会会员企日均产量环比降2.33%,据中钢协,中钢协会员企业10月下旬粗钢日均产量190.57万吨,旬比降2.33%;旬末钢企钢材库存1222万吨,旬比降5.33%;

11月12日,唐山市重污染天气应急预案》正式印发,据唐山政府网,近日,唐山正式印发《唐山市重污染天气应急预案》,《预案》指出,重污染天气预警统一以空气质量指数(AQI)日均值为指标,按连续24小时(可以跨自然日)均值计算,以AQI>200持续天数作为各级别预警启动的基本条件。按照污染控制分区和污染范围,将预警分为城市预警和区域预警。按照重污染天气发展趋势和严重性,将预警分为三个等级,由低到高依次为黄色预警、橙色预警、红色预警。

铁矿石

11月9日普氏62%铁矿石指数报77.25美元/吨,较前一交易日上涨1.00美元/吨,涨幅1.31%,连续两日上涨。

11月12日,2018年10月黑德兰港口铁矿石出口总量为4017万吨,环比9月减少(4351万吨)下降7.7%,去年同期为4100万吨,同比下降2.0%。其中出口到中国的铁矿石总量达3278万吨,环比9月(3739万吨)下降12.3%。

必和必拓一辆满载矿石的火车在纽曼矿区开往黑德兰港的途中脱轨,导致目前必和必拓所有运输列车停运,恢复时间暂未知。



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: 021-51557562

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

11/12, 螺纹开盘 3922, 盘中最低 3818, 尾盘报收 3848; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4500 元/吨; 天津: 4410 元/吨, 相比上交易日-80/-70, 基差 652, 偏高, 期货下跌致期货贴水轻微扩大, 唐山钢坯 3820 元/吨, 与前日持平; 盘面利润(理论) 364, 收窄; 唐山重污染天气应急预案正式印发, 10月下旬中钢协企业粗钢日均产量 190.57 万吨(-2.33%), 但产量同比较高; 厂库: 176.23

(+5.44) 社库: 335.44 (-19.48), 厂/社分化; 北材南下发货同比较高, 成交降温, 现货下跌, 厂库出现垒库, 盘面高位震荡偏弱; 铁矿石今日下跌报收 520.0, 现货 pb 粉(湿基): 592 (+2); 必和必拓火车脱轨, 目前影响不大, 黑德兰港口铁矿石出口总量为 4017 万吨(-4351), 日均疏港量: 296.2 (-11.63), 库存: 14281.57 (-75.53); 日均疏港量处高位转弱, 库存下降, 支撑价格, 但唐山地区下周二级污染预警限产, 或影响后续需求。

操作建议: 目前利润回落 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	4500	-80			
	天津	4410	-70			
	螺纹01-05	364		3848	-85	652
	盘面利润	334.71				
现货模拟利润	986.71					
热卷	上海	4120	-40			
	天津	4020	-50	3605	-30	515
	热卷01-05	199				
钢坯	唐山	3820	0			
铁矿 pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	592	2	520	-5	72
	铁矿09-01	33				
二级焦炭	唐山	2615	0	2303	-48	312

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。