

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: 021-51557562

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



一. 行业新闻

钢材

11月22日, 11月上旬全国重点钢企粗钢日均产量191.64万吨, 较上一旬增长0.57%。11月上旬末, 重点钢企钢材库存量1222.88万吨, 较上一旬末增长0.07%。

11月22日, 经河北省环境应急与重污染天气预警中心、中国环境监测总站、河北省环境气象中心联合会商, 预计11月24日至27日, 受近地面偏南气流、高湿和逆高温影响, 河北省中南部(石家庄、保定、衡水等)污染扩散条件持续转差, 可能出现中度至重度污染过程, 将达到橙色预警水平。为了减轻不利气象条件对环境空气质量的影响, 切实保障人民群众身体健康, 根据河北省大气办要求, 石家庄市自11月22日12时启动重污染天气II级应急响应。解除时间另行通知。

11月22日, 北材南下船运通: 发货维持高位, 华东华南到货增加、山东下降, 据卓钢链, 本周北方发货情况来看, 在第45周发货量冲上80万吨大关之后, 第46周继续保持, 为81.21万吨。而从监测的数据来看, 历史上该口径发货超过80万吨的周数仅有3次, 除了今年这两次, 只有2017年最后一周有一次, 为85.32万吨。所以, 传统的高峰期还没来, 北材就已经以排山倒海之势挥军南下了。

铁矿石

11月21日, 普氏62%铁矿石指数报73.40美元/吨, 较前一交易日下跌0.10美元/吨, 跌幅0.14%, 连续两日下跌。

11月21日, 河北、东北等地区受重污染天气影响, 国产铁矿石资源仍然较为紧张, 价格略有小幅上涨, 但钢厂整体大量采购意愿不强, 操作积极性偏低。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

11/22, 螺纹开盘 3723, 盘中最低 3690, 尾盘报收 3729; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4030 元/吨; 天津: 4030 元/吨, 相比上交易日-170/-110, 基差 301, 偏高, 现货下跌致期货贴水快速收窄, 唐山钢坯 3400 元/吨, 与前日-50; 盘面利润(理论) 340.01; 据鞍钢日报中国宝武董事长到访鞍钢深化交流合作, 携手共赢发展; 河北进入重污染预警, 当地钢厂或错峰生产, 11 月上旬重点钢企粗钢日均产量 191.64 万吨(+1.07), 产量依旧同比偏高; 北材发货维持高位, 华东华南到货增加、山东下降; 供应量偏高, 需求转淡, 现货下跌, 盘面承压, 震荡下行; 铁矿石上涨报收 518.5, 现货 pb 粉(湿基): 576(-4); 到港总量为 2129.8 万吨(+108.7), 华北地区下降, 钢厂利润下降, 低品矿采购意愿增加, 进口矿平均可用天数 26 天(-2), 库存 14273.01(-8.86); 港口矿结构好转, 现货较强, 支撑价格, 但高炉检修或对需求造成影响。

操作建议: 目前利润 300 附近, 盘面承压, 震荡下行, 短线区间操作, 或择机逢高反套 01-05, 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	4030	-170			
	天津	4030	-110			
螺纹01-05		281		3729	5	301
盘面利润		340.01				
现货模拟利润		641.01				
热卷	上海	3990	-40			
	天津	3830	-50	3591	-25	399
热卷01-05		194				
钢坯	唐山	3400	-50			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	576	-4	518.5	-8	57.5
铁矿09-01		35				
二级焦炭	唐山	2515	50	2266	-23	249

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。