

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26日, 安阳发布关于调整重污染天气橙色预警特别管控措施的通知。通知要求, 从11月22日20时起, 全市钢铁企业执行以下应急, 安钢: 在错峰生产基础上, 1台在用烧结机停产, 2台在用高炉压减生产负荷, 全厂日均粗钢产量控制在9500吨以内, 严禁污染防治设施不正常运转, 氨水使用量不可超过设计要求。其他钢铁企业: 在错峰生产基础上, 在用烧结机全部停产, 在用高炉同步压减生产负荷。

11月26日, 唐山旭日螺纹钢3730元/吨, 降40。

11月26日, 中钢协秘书长: 预计2019年长材将平稳运行, 11月23日, 中国钢铁工业协会党委书记兼秘书长刘振江在主题演讲中表示, 2019年行业环保治理工作和兼并重组将继续推进。他同时表示, 钢铁行业去产能和供给侧改革的主要受益品种是长材, 预计2019年长材价格仍将平稳运行, 而板材走势还要观察下游需求。

根据国家统计局数据, 10月份全国生铁、粗钢和钢材产量分别为6774万吨、8255万吨和9802万吨, 分别同比增长7.3%、9.1%和11.5%。1-10月, 全国生铁、粗钢和钢材产量分别为64506万吨、78246万吨和91844万吨, 分别同比增长1.7%、6.4%和7.8%。

铁矿石

11月23日, 普氏62%铁矿石指数报68.90美元/吨, 较前一交易日下跌3.15美元/吨, 跌幅4.37%, 连续四日下跌。

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

11/26, 螺纹开盘 3600, 盘中最低 3496, 尾盘报收 3553; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3840 元/吨; 天津: 3830 元/吨, 相比上交易日-130/-180, 基差 287, 偏高, 现货下跌致期货贴水快速收窄, 唐山钢坯 3430 元/吨, 与前日持平; 盘面利润(理论) 287.36; 唐山重启重污染应急 ABCD 类钢厂分别停产 30%、50%到全停不等, 安阳安钢也进入高炉检修期, 但 10 月粗钢产量 8255 万吨(+9.1%), 同比较高; 螺纹厂库: 193.72 (+7.06), 社库: 306.85 (-10.6), 社库拐点隐现; 供应量偏高, 需求转淡, 现货下跌, 厂库垒库, 盘面承压, 震荡下行; 铁矿石今日封停 477.5, 现货 pb 粉(湿基): 555 (-21); 到港总量为 2129.8 万吨(+108.7), 日均疏港总量继续下降至 278.56 万吨(-8.73), 库存 14314.08 (+41.07); 钢厂利润下降叠加高炉检修对需求造成影响, 疏港量下降, 轻微垒库, 现货下跌, 震荡偏弱。

操作建议: 目前利润回落 200 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。铁矿石震荡偏弱, 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 | 3840 | -130 | | | |
| | 天津 | 3830 | -180 | | | |
| | 螺纹01-05 | 321 | | 3553 | -70 | 287 |
| | 盘面利润 | 287.36 | | | | |
| 现货模拟利润 | 574.36 | | | | | |
| 热卷 | 上海 | 3940 | -40 | | | |
| | 天津 | 3820 | -50 | 3392 | -85 | 548 |
| | 热卷01-05 | 222 | | | | |
| 钢坯 | 唐山 | 3430 | 0 | | | |
| 铁矿 pb (湿基) | 华北 (曹妃甸) | 555 | -21 | 477.5 | -19.5 | 77.5 |
| | 铁矿 09-01 | 28 | | | | |
| 二级焦炭 | 唐山 | 2415 | 100 | 2115 | -73 | 300 |

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。