

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

中国 11 月财新制造业 PMI 50.2, 预期 50.1, 前值 50.1。
11 月新出口订单指数 47.7, 前值 48.8。

12 月 4 日, 11 月份, 河北省钢铁行业 PMI (采购经理指数) 为 44.2%, 环比下降 6.5 个百分点, 再度回落至收缩区间。

12 月 4 日, 据德州环保局, 目前, 德州市空气质量已满足解除条件。经市重污染天气监测预报组与一市一策专家组会商, 未来气象条件利于污染物扩散。市重污染天气应急指挥部决定从 12 月 4 日 8 时起, 终止 II 级应急响应。此前, 北京市也解除重污染天气应急响应。

12 月 4 日, 马钢对马鞍山和合肥地区建材价格调整如下: 螺纹: 价格上涨 30 元, 现合肥地区 $\Phi 20\text{mm}$ HRB400 螺纹钢执行价格为 4140 元/吨。

12 月 4 日, 上午 8 点 30 分, 唐山象屿正丰总库存 10 万吨, 其中钢坯库存 9.4 万吨。另外 11 月 3 日早八点到 12 月 4 日早八点, 总入库量为 0.53 万吨, 其中钢坯 0.52 万吨, 总出库量 0.91 万吨, 其中钢坯 0.81 万吨。

铁矿石

12 月 3 日, 普氏 62%铁矿石指数报 66.15 美元/吨, 较前一交易日上涨 0.70 美元/吨, 涨幅 1.07%, 止步两连跌。

12 月 4 日, 全国主要港口铁矿累计成交 95.20 万吨, 较昨日增加 64.14%; 上周平均每日成交 69.88 万吨, 上月平均每日成交 78.08 万吨。

12 月 4 日, 昆巴称火车停运不会影响铁矿石产量目标的实现。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

12/4, 螺纹开盘 3306, 盘中最低 3283, 尾盘报收 3374; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3980 元/吨; 天津: 3780 元/吨, 相比上交易日-30/+0, 基差 606, 偏高, 期货上涨致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3330 元/吨, 与前日+250; 盘面利润(理论) 303.16; 11月河北省钢铁行业 PMI 为 44.2%, 环比下降 6.5 个百分点; 北京、德州等地解除空气污染预警, 京津冀部分地区继续实施错峰生产, 但钢铁产量同比依旧偏高; 供应量偏高, 采购下滑, 厂库垒库, 盘面承压, 窄幅震荡, 偏弱; 铁矿石上涨至 472, 现货 pb 粉(湿基): 530 (+13); 昆巴称火车停运不会影响铁矿石产量, 到港总量增加, 港口矿累计成交 95.20 万吨(+64.14%), 销库温和; 钢厂利润下降叠加高炉检修对需求造成影响, 销库温和, 现货上涨, 宽幅震荡, 偏弱。

操作建议: 目前利润 300 附近, 盘面承压, 窄幅震荡偏弱, 短线区间操作, 或择机逢高反套 01-05, 注意控制风险。铁矿石宽幅震荡, 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	3980	-30			
	天津	3780	0			
螺纹05-10		150		3374	41	606
盘面利润		303.16				
现货模拟利润		909.16				
热卷	上海	3920	-40			
	天津	3810	-50	3276	41	644
热卷05-10		108				
钢坯	唐山	3330	250			
铁矿 pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	530	13	472	9	58
		20				
二级焦炭	唐山	2165	0	2306.5	67.5	-141.5

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。