

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

一. 行业新闻

钢材

12月13日,据SMM钢铁了解,徐州此前只有三家钢厂正常生产,其中JH与昨日停产,HH今日被政府约谈,近日或停产,DN表示等待政府通知,或也于近日停产,预计停产半个月左右,

12月13日,据亳州环保局,为进一步强化大气污染防治工作,积极应对重污染天气,切实保障人民群众身体健康,根据《长三角区域2018-2019年秋冬季大气污染综合治理攻坚行动方案》和《安徽省大气办关于采取空气环境质量临时特别管控措施的紧急通知》要求,决定于12月12日22时起,采取空气环境质量临时特别管控措施。

12月13日,济南环保局,根据中国环境监测总站与京津冀及周边地区省级环境监测中心会商结果,受不利气象条件影响,预计12月14日至16日期间,京津冀及周边地区将出现一次区域性重污染天气过程。其中山东省大部分城市空气质量可能出现连续3天以上重度污染天气。为有效应对重污染天气,山东省重污染天气应急工作小组办公室下发《关于切实做好12月14日至12月16日重污染天气过程应对工作的函》,要求包括济南在内的山东省12个地市发布橙色预警并启动II级应急响应。按照国家区域应急联动部署和省生态环境厅要求,济南市已于12月13日9时发布重污染天气橙色预警,并于12月13日24时启动II级应急响应。

12月13日,据期货日报,近期全国迎来大范围雨雪天气,加之临近年底,终端需求继续萎缩,钢材成交环比小幅下降。面对需求的疲弱,钢厂主动降低产能利用率。目前,钢厂产能利用率连续回落,装置检修意愿增强。统计数据显示,截至上周末,全国钢厂产能利用率(不含淘汰产能)为82.11%,环比下降1.06%。钢厂降低产能利用率,一来可以避免利润由正转负时可能面临的亏损,二来通过降低产量遏制价格的再度下跌。

铁矿石

12月12日,普氏62%铁矿石指数报67.15美元/吨,较前一交易日上涨0.20美元/吨,涨幅0.30%,连续两日上涨。

12月13日,巴西贸易发展部报告称,2018年11月巴西对华铁矿石出口供给1991万吨,较去年同期增加2%。



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

12/13, 螺纹开盘 3325, 盘中最低 3321, 尾盘报收 3419; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3850 元/吨; 天津: 3630 元/吨, 相比上交易日+20/+30, 基差 431, 偏高, 期货上涨致期货贴水收窄, 唐山钢坯 3310 元/吨, 与前日+30; 盘面利润(理论) 306.68; 邯郸自 12 月 12 日 18 时启动 II 级应急响应, 钢铁等重点行业企业实行差异化错峰生产, 唐山、邯郸两地近期环保有所收紧, 但产量同比偏高; 厂/社库双降, 钢贸商冬储意愿偏低; 供应量偏高, 雨雪南下影响汽运, 需求减弱, 盘面窄幅震荡, 偏弱; 铁矿石上涨至 478.5, 现货 pb 粉(湿基): 537; 发货总量微增, 可用天数轻微下降, 库消比持续下降; 补库意愿较低, 成交下滑, 但到港压力稍缓, 销库温和, 目前跟随钢价企稳, 宽幅震荡。操作建议: 目前利润 300 附近, 螺纹盘面企稳, 窄幅震荡偏弱, 短线区间操作, 或择机逢高做空钢厂利润, 注意控制风险。铁矿石宽幅震荡, 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	3850	20			
	天津	3630	30			
螺纹05-10		150		3419	102	431
盘面利润		306.68				
现货模拟利润		737.68				
热卷	上海	3960	-40			
	天津	3750	-50	3470	154	490
热卷05-10		157				
钢坯	唐山	3310	30			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	537	0	478.5	4.5	58.5
铁矿05-09		18.5				
二级焦炭	唐山	2165	0	2406	53.5	-241

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。