

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

1 月 9 日，江苏解除重污染天气黄色预警，据江苏生态环境厅，经与省气象台会商，受雨雪过程以及偏东风风力加大影响，江苏省大气扩散条件转好。预计 1 月 9 日起，江苏省空气质量将逐步好转，达到《江苏省重污染天气应急预案》解除预警的条件，于 1 月 9 日 14 时，解除全省重污染天气黄色预警。

1 月 9 日，天津政务网发布《天津市人民政府办公厅关于印发天津市重污染天气应急预案的通知》。其中，将重污染天气预警级别从蓝色、黄色、橙色、红色预警四个级别调整为三个级别，从低到高分黄色、橙色和红色预警三级，红色为最高级别。采暖季对钢铁、建材、焦化、铸造、有色、化工等重点行业实行差异化错峰生产。

1 月 9 日，据上海证券报，工信部日前公布了《钢铁行业产能置换实施办法》，对原有的产能置换规则进行了修订。在业内人士看来，这是钢铁行业供给侧改革继续推进的标志，而随着钢铁行业效益的好转，今年改革的重心将转向去杠杆和兼并重组。

1 月 9 日，据中国证券网，全国生态环境工作会议将于近期召开，会议将对今年环保工作作出具体安排部署。从生态环境部高层近期的公开表态来看，打好污染防治攻坚战仍是今年工作核心内容，重点在促进经济高质量发展，生态环境保护督察的力度不会减弱，但会加强对企业的帮扶工作。

铁矿石

1 月 8 日，普氏 62%铁矿石指数报 74.95 美元/吨，较前一交易日持平。

1 月 9 日，IndiOre 矿业公司印度 P3 铁矿石项目的最新进展。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

1/9, 螺纹开盘 3505, 盘中最低 3494, 尾盘报收 3507; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3800 元/吨; 天津: 3710 元/吨, 相比上交易日-10/+0, 基差 293, 偏高, 现货下跌致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3380 元/吨, 与昨日+20, 盘面利润(理论) 419.76; 工信部日前公布了《钢铁行业产能置换实施办法》钢铁行业供给侧改革继续推进, 重心将转向去杠杆和兼并重组; 天津重污染预案修改预警等级钢铁等行业差异化错峰生产, 螺纹实际产量或继续小幅下降; 基建加码, 需求预期转强, 行业内重点兼并重组产量或环比小幅减少, 冬储意愿偏淡, 盘面窄幅震荡; 铁矿石下跌至 509.5, 现货 pb 粉(湿基): 568; 全国到港总量为 1974.5 万吨(-354), 日均疏港量下降 264.03 万吨(-1.20), 但处高位, 库存温和垒库; 发货量持续减少, 日均疏港量高位, 现货上涨, 盘面宽幅震荡, 偏强。操作建议: 目前利润 400 附近, 螺纹盘面窄幅震荡, 短线区间操作, 或择机逢低正套 05-10, 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	3800	-10			
	天津	3710	0			
螺纹05-10		187		3507	2	293
盘面利润		419.76				
现货模拟利润		712.76				
热卷	上海	3870	-40			
	天津	3780	-50	3421	18	449
热卷05-10		165				
钢坯	唐山	3380	20			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	568	0	509.5	-4.5	58.5
铁矿05-09		26.5				
二级焦炭	唐山	1965	-50	2069.5	-100.5	-104.5

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。