

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report



中融汇信期货

徐懔琛

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 10 日, 中国 12 月 PPI 同比 0.9%, 为 2016 年 9 月以来最低, 预期 1.6%, 前值 2.7%。

1 月 10 日, 永钢公布 2019 年 1 月中旬至 2 月中旬的建材计划折扣量, 其中 1-2 期螺纹钢为 8.5 折, 线材和盘螺不打折; 1-3 期螺纹钢为 6 折, 线材和盘螺为 8 折; 2-1 期螺纹钢为 6 折, 线材和盘螺为 8 折; 2-2 期螺纹钢为 6 折, 线材和盘螺 8 折。

1 月 10 日-14 日, 京津冀及周边地区中南部和汾渭平原将出现一次区域性中至重度污染过程, 个别城市将达到严重污染级别, 影响范围包括京津冀中南部、河南大部、山东西部, 以及汾渭平原城市。目前, 河北、山西、河南省部分城市根据当地空气质量预测预报结果, 已经发布重污染天气预警。

1 月 10 日, 本周广州 17 家主流仓库螺纹钢 49.86 万吨, 增加 5.42 万吨。线材盘螺 34.34 万吨, 增加 0.82 万吨。目前广州建筑钢材总库存为 84.2 万吨, 较上周增加 6.24 万吨, 较去年同期增加 0.81 万吨。

铁矿石

1 月 9 日, 普氏 62%铁矿石指数报 74.50 美元/吨, 较前一交易日下跌 0.45 美元/吨, 跌幅 0.60%。

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

1/10, 螺纹开盘 3512, 盘中最低 3502, 尾盘报收 3514; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3800 元/吨; 天津: 3740 元/吨, 相比上交易日+0/+30, 基差 286, 偏高, 现货上涨致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3400 元/吨, 与前日+20, 盘面利润(理论) 426.76; 中国 12 月 PPI 同 0. 比 0. 9%, 预期 1. 6%, 前值 2. 7%; 京津冀地区和汾渭平原启动污染预警, 当地钢厂差异化错峰生产, 但螺纹实际产量 329. 94 (+3. 51); 贸易商建材成交量 12. 98 万吨, 上周平均为 15. 5。基建加码, 需求预期转强, 行业内产量环比小幅增加, 冬储成交转淡, 盘面窄幅震荡; 铁矿石下跌至 506. 5, 现货 pb 粉(湿基): 568; 全国到港总量为 1974. 5 万吨(-354), 进口矿平均可用天数 30 天(+1), 库存消费比 30. 43(+0. 94); 发货量持续减少, 库消比轻微增加, 现货维持, 盘面宽幅震荡。

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, 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	0			
	天津	3740	30			
螺纹05-10		195		3514	7	286
盘面利润		426.76				
现货模拟利润		712.76				
热卷	上海	3860	-40			
	天津	3770	-50	3421	0	439
热卷05-10		165				
钢坯	唐山	3400	20			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	568	0	506.5	-3	61.5
铁矿05-09		24.5				
二级焦炭	唐山	1965	0	2129.5	60	-164.5

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。