

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 30 日, 中天钢铁公布 2 月份计划量折扣暂定情况如下: 2 月份上、中、下旬分别为: 螺纹钢、普线和盘螺执行 5 折、5 折和全折计划量, 带钢执行零供应、5 折和 5 折计划量。

1 月 30 日, 铜陵富鑫钢铁由 130 万吨产能压减为 118 万吨。

1 月 30 日, 谷网中西部钢材库存调研统计如下: 1. 社库建材总量: 343.34 万吨, 较上周增加 39.17 万吨, 上升 12.88%; 热卷总量: 37.81 万吨, 较上周减少 1.14 万吨, 下降 2.93%; 中厚总量: 17.14 万吨, 较上周减少 0.61 万吨, 下降 3.41%。2. 厂库建材总量: 140.65 万吨, 较上周增加 7.28 万吨, 下降 0.51%。

铁矿石

1 月 29 日, 普氏 62%铁矿石指数报 79.95 美元/吨, 较前一交易日上涨 1.25 美元/吨, 涨幅 1.59%, 连续两日上涨。

1 月 30 日, 据外媒报道, 淡水河谷 CEO Fabio Schvartsman 表示: 公司已经决定不惜一切地结束大坝存在的安全隐患; 公司将在未来三年内坚定不移地停止类似于 Brumadinho 大坝那样的 19 座大坝的运营; 相关整顿预计花费近 11 亿美元; 关键决定每年将影响到 4000 万吨的铁矿石和 1100 万球团。

1 月 30 日, 巴西尾矿事故追踪报道: Vale 正式宣布关停 10 座大坝预计最大影响年产量 4000 万吨; 公司向巴西能源和环境部提出关闭 10 座上游水坝的申请, 并得到了批准。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

1/30, 螺纹开盘 3683, 盘中最低 3667, 尾盘报收 3677; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3780 元/吨; 天津: 3870 元/吨, 相比上交易日持平, 基差 103, 偏低, 期货上涨致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3430 元/吨, 与前日持平, 盘面利润(理论) 525.74; 铜陵富鑫钢铁由 130 万吨产能压减为 118 万吨; 吨钢利润回暖开工动力充足, 但环保因素依旧, 螺纹周产量或小幅下降; 中西部钢材社库 343.34 (+39.17)、厂库 140.65 (+7.28); 产量小幅减少, 冬储进行中西部垒库持续, 现货维持, 盘面震荡上行; 铁矿石上涨至 587.0, 现货 pb 粉(湿基): 603 (+16); Vale 宣布关停 10 座大坝预计最大影响年产量 4000 万吨, 财报显示原 19 年预计发货 4 亿吨, 现市场预期下调; 节前钢厂补库基本结束, 但淡水河谷供应减少, 短期内对盘面影响极大叠加节假日影响, 观望为主。

操作建议: 目前利润回升至 500 附近, 螺纹盘面震荡上行, 短线区间操作, 或择机逢低正套 05-10 (216), 注意控制风险。铁矿石淡水河谷尾矿坝泄漏叠加节假日影响, 观望为主。

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	3780	0			
	天津	3870	0			
螺纹05-10		216		3677	2	103
盘面利润		525.74				
现货模拟利润		628.74				
热卷	上海	3910	-40			
	天津	3900	-50	3582	-7	328
热卷05-10		170				
钢坯	唐山	3430	0			
铁矿pb (湿基) 华北 (曹妃甸)		603	16	587	26.5	16
	铁矿05-09	35				
二级焦炭	唐山	1965	0	2020	-6	-55

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。