

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：021-51557597

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

2月14日，据中商产业研究院数据库显示，2018年1-3季度安徽省钢材产量整体波动幅度较小，波动幅度不超5%。2018年12月安徽省钢材产量为252.3万吨，同比增长2.6%。2018年安徽省钢材产量为3227.2万吨，同比增长7.2%。

2月14日，海关总署：中国1月稀土出口3752.9吨，去年12月为5421吨；钢材出口为618.8万吨，去年12月为556万吨；未锻轧铝及铝材出口55.2万吨，去年12月为53万吨。

2月14日，全国钢厂调价信息汇总华东，雨花对南京地区建材价格下调30元。华北，唐山玄龙螺纹钢出厂降20元，三级12-14mm螺纹钢出厂价格4000元/吨，三级16-22mm螺纹钢出厂价格4000元/吨，抗震加价100元，过磅，含税460。

2月14日，据钢联库存数据，本周螺纹社会库存827.69万吨，周环比增加103.10万吨。线材社会库存278.72万吨，周环比增加30.24万吨。螺纹钢厂库存339.52万吨，周环比增加15.54万吨。线材钢厂库存113.26万吨，周环比增加5.30万吨。热卷社会库存260.17万吨，周环比增加22.41万吨。产量方面，螺纹周产量292.12万吨，较上周减少1.06万吨。线材周产量130.78万吨，较上周减少2.61万吨，热卷周产量331.59万吨，较上周增加2.06万吨。

铁矿石

2月14日，澳洲发往全球的量为1454.7万吨，环比减少139.9万吨。发往中国的量1329万吨，环比减少67.6万吨。巴西铁矿石发货总量为481.6万吨，环比减少238.6万吨。

2月14日，全国主要港口铁矿累计成交53.50万吨，环比下降7.76%；上周平均每日成交41.55万吨，上月平均每日成交106.20万吨。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

2/14, 螺纹开盘 3711, 盘中最低 3668, 尾盘报收 3684; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3840 元/吨; 天津: 3880 元/吨, 相比上交易日-20/+0, 基差 156, 中性, 期货下跌致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3430 元/吨, 与昨日+0, 盘面利润(理论) 415.54; 螺纹周产量 292.12 (-1.06), 厂库: 339.52 (+15.54), 社库: 827.69 (+103.1); 产量小幅减少, 重点关注需求情况, 目前盘面震荡上行, 但按照目前 14.2%增幅后期库存压力偏大; 铁矿石上涨至 624, 现货 pb 粉(湿基): 650 (-19); 澳洲发往全球的量为 1454.7 万吨 (-139.9), 铁矿累计成交 53.50 万吨 (-7.76%), 钢厂采购受矿难影响观望为主; 铁矿减产预期再次上升, 总供需平衡受影响, 供应偏紧或成主导, 短期内对盘面影响极大, 盘面高位震荡。

操作建议: 目前利润维持在 430 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 (215), 注意控制风险。铁矿石受淡水河谷尾矿坝泄漏影响, 高位震荡, 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	3840	-20			
	天津	3880	0			
螺纹05-10		215		3684	-18	156
盘面利润		434.62				
现货模拟利润		590.62				
热卷	上海	3930	-40			
	天津	3940	-50	3606	-2	324
热卷05-10		176				
钢坯	唐山	3430	0			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	650	-19	628.5	4.5	21.5
铁矿05-09		46.5				
二级焦炭	唐山	1965	0	2088.5	22.5	-123.5

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。