

# 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18日,盐城宝武钢铁基地定位为“未来钢厂”,为了确保项目早日开工,宝钢股份将按照本次会谈达成的共识,统筹推进抓好落实,努力将宝武钢铁基地建设成为环保、智慧、效率全方位领先的世界级“未来钢厂”。

2月18日,临汾市扩散条件开始转差,可能出现一次中度污染至重度污染过程,短时可能达到严重污染。首要污染物为PM2.5,决定从2月17日0时起,启动重污染天气橙色预警(二级)。临汾市将采取应急相应减排措施,其中涉及钢铁生产及工程施工方面的强制性减排措施包括:对纳入重污染天气预警应急减排清单的企业实施停限产的基础上,a钢铁企业炼铁高炉休风,烧结、球团设备停产;b铸造企业(除电炉外)全部停产;c煤气发生炉全部停产;d所有工业企业加强厂区扬尘控制

### 铁矿石

2月18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。

2月18日,据麦格理:将2019年铁矿石价格预期上调22%,至77美元/吨,将2020年铁矿石价格预期上调3%,至65美元/吨。上调必和必拓、力拓和福蒂斯库金属集团(FMG)的盈利预期。

2月18日,VALE官方消息称,对分析报告数据进行修正后,公司决定将对Mar Azul矿区B3/B4号坝的应急预案已升至2级。目前VALE已加强B3/B4号坝检查工作,本次最新检验由巴西国家矿业机构进行,且未发现本次技术数据有任何异常,与上月进行的数据检验结果一致。VALE正在进行Macacos地区附近200名居民进行撤离工作,并暂时安置在社区中心,随后将为他们安排当地旅馆住宿。此前,VALE也曾于2月8日启动应急1级预案,疏散Gongo Soco矿区的Sul Superior尾矿坝附近500名居民,2月10日时完成居民临时安置工作。

# 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

## 二. 行情分析

2/18, 螺纹开盘 3615, 盘中最低 3611, 尾盘报收 3659; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3810 元/吨; 天津: 3840 元/吨, 相比上交易日-30/-40, 基差 151, 中性, 期货上涨致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3430 元/吨, 与前日+40, 盘面利润(理论) 340.84; 钢铁行业内整合置换升级, 盐城宝武钢铁基地定位为“未来钢厂”; 临汾市启动重污染天气橙色预警, 环保扰动产量, 产量小幅下降, 但受节假日影响采螺量下降至 1860 (87.87%), 按照目前 14.22%的增幅后期库存压力偏大, 目前盘面震荡上行转弱, 重点关注后续需求; 铁矿石上涨至 628, 现货 pb 粉(湿基): 654 (+4); 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: 目前利润回落至 350 附近, 螺纹盘面震荡上行转弱, 短线区间操作, 或择机逢低正套 05-10 (210), 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	3810	-30			
	天津	3840	-40			
螺纹05-10		210		3659	60	151
盘面利润		340.84				
现货模拟利润		491.84				
热卷	上海	3850	-40			
	天津	3840	-50	3624	89	226
热卷05-10		184				
钢坯	唐山	3430	40			
铁矿pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	654	4	628	4	26
铁矿05-09		41.5				
二级焦炭	唐山	2065	100	2068	25.5	-3

## 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。