

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: 中国(上海)自由贸易试验区
东育路255弄5号29层



一. 行业新闻

钢材

4月3日,据中钢协,3月中旬中钢协会会员企业粗钢日均产量为190.23万吨,旬环比增0.95%;中旬末钢企钢材库存为1385万吨,旬环比降4.72%。

4月3日,据生态环境部,4月中上旬,全国空气质量以良为主。其中,3-6日,京津冀中南部、长三角北部、华南北部和东北区域可能出现轻度污染过程,京津冀中南部局地可能出现短时中度污染,首要污染物为PM2.5;7日前后,西北和京津冀及周边部分地区受沙尘天气影响,可能出现短时中度及以上污染过程,首要污染物为PM10;14日前后,西北地区可能再次出现沙尘过程。受生物质燃烧影响,东北和西南局地空气质量在现有预报基础上可能略有偏高。此外,考虑可能受清明节祭扫影响,部分地区空气质量在预报等级基础上可能增加1-2级。

铁矿石

4月2日,普氏62%铁矿石指数报89.65美元/吨,较前一交易日上涨1.75美元/吨,涨幅1.99%,连续三日上涨。

4月3日,热带低地(这次被命名为华莱士)正在阿拉弗拉海上进行组织,根据最新天气预报,下周二影响黑德兰港的强风强度较先前预测有所增加,预计强度为9-10级风,下周或将对黑德兰港产生重大影响。上周维罗妮卡对西澳的生产造成了较大的影响,未来一周需更多关注新飓风华莱士。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

4/3, 螺纹 1910 开盘 3560, 盘中最低 3546, 尾盘报收 3587; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3960 元/吨; 天津: 4000 元/吨, 相比上交易日+10/+40, 基差 400, 期货上涨致期货贴水收窄, 唐山钢坯 3450 元/吨, 与昨日持平, 盘面利润(理论) 415.11; 唐山市钢铁行业遵化市等钢铁企业停 50%以上的烧结机、古冶区等停 20%以上的烧结机, 但电弧炉开工率上升较快, 总体产量变动温和; 社会库存 872.28 万吨(-44.66), 厂库 246.55 万吨(-8.79), 厂/社库双降, 今年需求启动早于去年同期, 但随着土地成交下降对新开工的拖累显现, 需求隐忧渐进, 目前盘面高位震荡; 铁矿石上涨至 690.5, 现货 pb 粉(湿基): 645(+11); 热带低地(这次被命名为华莱士)正在阿拉弗拉海上进行组织, 下周二影响黑德兰港的强风强度较先前预测有所增加, 预计强度为 9-10 级风, 下周或将对黑德兰港产生重大影响; 淡水河谷依据官方宣布 2019 年铁矿销售量预计在 3.07 亿吨至 3.32 亿吨, 少于市场预期, 利好盘面。日均疏港方面均值 280 附近, 最新: 277.14, 环比下降 15.66, 但依旧处于高位, 因青岛与沿江港口转水量下降; 行业内, 钢厂采购偏向积极, 港口库存 14702.93, 环比下降 85.63, 继节后库存 6 连涨后, 首次出现降库; 盘面受飓风影响, 高位震荡, 偏强。

操作建议: 目前利润 400 附近, 螺纹盘面震荡, 短线区间操作, 可适当平仓逢低正套 05-10(278), 注意控制风险。铁矿石高位震荡偏强, 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	3960	10	3560	0	400
	天津	4000	40			
螺纹05-10		278				
盘面利润		415.11				
现货模拟利润		815.11				
热卷	上海	4050	-40	3771	0	279
	天津	3990	-50			
热卷05-10		270				
钢坯	唐山	3450	0			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	645	11	662.5	0	-17.5
		铁矿05-09	51.5			
二级焦炭	唐山	1850	0	2004.5	0	-154.5

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。