

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9日,全国共有17家钢厂调整出厂价格,从统计的数据看,4月9日调价钢厂以华东区域为主,均为上调。具体调整如下:华东南钢:螺纹上调30元/吨;长江:螺纹、盘螺上调40元/吨;莱钢永峰:螺纹上调30元/吨,盘螺上调50元/吨;

4月9日,唐山象屿正丰总库存37.9万吨,其中钢坯库存34.3万吨。另外4月8日早八点到4月9日早八点,总入库量为0.2万吨,其中钢坯0.19万吨,总出库量0.98吨,其中钢坯0.98万吨。

4月8日,临汾限产延期至11,19座钢厂高炉受影响,现临汾区域有正常流通资源钢厂7家,其中酒钢翼城已经申请破产。在有正常流通资源的钢厂中,本次停限产实际影响到6家钢厂,高炉总计为19座,总容积为12080m³;所有钢种轧线总计为32条,所有轧材产线日产量约在4.75万吨左右。

铁矿石

4月8日,普氏62%铁矿石指数报92.90美元/吨,较前一交易日持平。

4月9日,巴西铁矿运费参考价格为13.2美元,环比增长0.01%,澳洲铁矿运费参考价格为5.2美元,环比增长0.04%。

4月9日,澳洲巴西发货总量为1604万吨,环比增加381.1万吨;澳洲发往全球的量为1398.3万吨,环比增加642.3万吨。发往中国的量1181.2万吨,环比增加565.7万吨。巴西铁矿石发货总量为205.7万吨,环比减少261.2万吨。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

4/9, 螺纹 1910 开盘 3735, 盘中最低 3728, 尾盘报收 3757; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4100 元/吨; 天津: 4070 元/吨, 相比上交易日+50/+30, 基差 343, 现货上涨致期货贴水扩大, 唐山钢坯 3550 元/吨, 与昨日+40, 盘面利润(理论) 524.36; 今年相对前两年对长流程产钢的依赖度下降, 电炉产能不断增加, 且当前螺纹钢平均含税成本为 3541 元/吨, 环比减少 10 元/吨; 螺纹钢利润 322 元/吨, 较上月增加 49 元/吨, 螺纹产量方面, 恢复明显快于去年同期, 后期依然有释放空间。螺纹周产量 330.69 万吨, 较上周增加 5.57 万吨, 产量环比继续有较大幅度增加; 螺纹社库 872.28, 环比减少 44.66 万吨, 厂库 246.55 万吨, 环比减少 8.79 万吨, 厂/社双降, 且去化加速, 周度消费创历史新高, 当前市场整体需求仍维持旺季水平, 但产量恢复明显快于去年同期, 且后期依然有释放空间, 高产量仍是多头的隐患, 且目前实际需求没有问题, 但随着下游工地工期进度和消耗下降, 就会带来成交量下滑, 采购缩量会蔓延到现货价格下跌; 综上, 目前外矿供应缩减致矿价大幅反弹带动黑色整体偏强运行, 短期受成本以及现货支撑, 盘面偏强运行; 铁矿石 09 上涨至 648.0, 现货 pb 粉(湿基): 679(+25); 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, 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, 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, 港口铁矿石库存为 14843.43 万吨, 较上周增 140.5 万吨; 但盘面受飓风影响, 高位震荡, 偏强。

操作建议: 目前利润 500 附近, 螺纹盘面震荡, 短线区间操作, 逢高平仓正套的 05-10(298), 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	4100	50			
	天津	4090	30			
螺纹05-10		298		3757	25	343
盘面利润		524.36				
现货模拟利润		867.36				
热卷	上海	4140	-40			
	天津	4070	-50	3941	-3	199
热卷05-10		260				
钢坯	唐山	3550	40			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	679	25	706.5	-5.5	-27.5
铁矿05-09		58.5				
二级焦炭	唐山	1850	0	2017	-31.5	-167

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

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

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。