

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report



一. 行业新闻

钢材

4月23日,据中钢协最新数据显示,4月上旬全国重点钢铁企业粗钢日均产量195.50万吨,较上一旬增6.56%。4月上旬末,重点钢铁企业钢材库存量1234.62万吨,较上一旬末增6.2%。

4月23日,黑龙江建龙钢厂3月5日停产的一条棒材轧线,现于4月19日已经复产,本月螺纹计划产量约4.2万吨。

4月23日,据新华社,从河北省唐山市发改委了解到,这个市日前启动了主城区周边13家钢铁企业优化整合、退城搬迁工作,涉及钢铁产能5135万吨。

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

铁矿石

4月22日,普氏62%进口矿指数93.6,涨1.8,月平均93.19;钢铁TSI62%指数93.6,涨1.8,月平均93.19。

4月23日,一季度NMDC铁矿石总产量为1060万吨,同比减少75万吨(6.6%);其中,恰蒂斯加尔邦(Chhattisgarh)产量为879万吨,同比增加38万吨(4.5%),卡纳塔克邦产量181万吨,同比减少113万吨(38.4%)。

4月23日,澳洲巴西发货总量为2123.5万吨,环比增加237.6万吨。澳洲发往全球的量为1761.8万吨,环比增加234.3万吨。发往中国的量1498.3万吨,环比增加241.2万吨。巴西铁矿石发货总量为361.7万吨,环比增加3.3万吨。

4月23日,第一季度,力拓集团铁矿石销量(全部)为6910万吨,同比下降14%,环比下降21%,其中铁矿石销量(应占份额)为5820万吨。



钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

4/23, 螺纹 1910 开盘 3776, 盘中最低 3755, 尾盘报收 3757; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4130 元/吨; 天津: 4130 元/吨, 相比上交易日-40/-10, 基差 373, 现货上涨致期货贴水扩大, 唐山钢坯 3570 元/吨, 与昨日+40, 盘面利润(理论) 576.05; 螺纹的供应方面关注 5 月环保的限产执行情况, 按照唐山第二至三季度错峰生产实施方案, 4、8、9 月份, 区域二烧结机限产 50%, A 类限产 20%。5、6、7 月份, 区域一按照此要求执行限产。由于长流程产能集中在区域一迁安、丰南等地, 整体限产比例高达 82%, 因此, 4 月份区域二执行限产时, 高炉受影响不大, 开工率回升速度也比较快。5 月份后, 限产比例提升, 较 4 月明显加强, 如果严格执行的话, 影响铁水日均产能约 10 万吨, 总体, 产量远高于往年, 近期供应无忧, 螺纹周产量 355.38 万吨, 较上周增加 5.39 万吨; 螺纹社库 709.79 万吨, 周环比减少 58.07 万吨; 厂库: 204.15 万吨, 周环比减少 2.71 万吨, 厂/社双降, 去化速度可观; 螺纹成交方面上周基本维持在 20 万吨附近, 处高位、线螺采购量: 43670 吨, 环比增加 7920; 受钢材现货冲高(有铁矿上涨影响)叠加下游消耗的增加, 需求进入峰值, 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, 后期若无政策刺激, 需求再出增量是小概率, 峰值之后拐点将至, 盘面高位震荡; 铁矿石 09 上涨 627, 现货 pb 粉(湿基): 664; 一季度铁矿供应情况: 澳洲矿山受到飓风影响, 整体产量和发货量均有明显下降; 巴西方面, 矿难和降水较多的影响下发货量也明显下降; 具体: 力拓: 8022 万吨, 环比下降 1119 万吨; 必和必拓 6361 万吨, 环比下降 191, FMG: 4800, 环比下降 120; 需求上, 钢厂高炉开工率为 70.03%, 钢厂的铁水日产量为 232.24 万吨, 偏高。去库状态下叠加钢厂高利润转弱, 低品价格会保持相对强势, 铁矿高低品价差维持在 80-90 附近, 使得高品矿也难以大跌, 盘面维持高位震荡。

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(390), 注意控制风险。铁矿石高位震荡, 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	4130	-40	3757	-3	373
	天津	4130	-10			
螺纹05-10		390				
盘面利润		546.02				
现货模拟利润		919.02				
热卷	上海	4200	-40	3984	-13	216
	天津	4090	-50			
热卷05-10		292				
钢坯	唐山	3550	0			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	669	5	700.5	0.5	-31.5
		铁矿05-09	71.5			
二级焦炭	唐山	1850	0	2030	4	-180

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

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

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。