

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

7月18日, 发货方面, 本期北方发货小幅减少, 但相较之前两年同期仍处高位。目前来看, 在市场价格震荡调整过程当中, 资源发运逐步趋于稳定。不过从当前发货总量来看, 供应已经明显处于历史相对高位, 所以接下来即将受到考验的是需求端到底能否匹配当前高压供应, 否则市场将面临非常大的压力调整。

7月18日, 经济参考报消息, 记者从知情人士处获悉, 我国将以更大力度, 更加精确地对高耗能产业进行停限产调节。据悉, 相关部门正在计划对钢铁、煤炭、水泥、化工等15个重点行业开展绩效分级评价和差异化管理。通过生产工艺水平、治理技术等多项指标制定绩效评级细则, 将行业企业分为A、B、C级, 在京津冀及周边、长三角区域、汾渭平原等环保重点区域, 根据不同天气条件, 根据等级采取不同的停限产措施。

7月18日, 中国6月工业增加值同比增长6.3%, 预估为5.2%, 前值为5%。

7月18日, 钢谷网统计的31家流通商建材成交量总计19558.49吨; 较上一交易日增加866.71吨, 增幅4.64%; 环比上周三成交量增加5038.97吨, 增幅34.70%; 较6月成交均值增加51.11吨, 增幅0.26%。

铁矿石

7月18日, 港口现货参考报价下跌, 其中曹妃甸港PB粉910跌15, 金布巴粉880跌10; 日照港PB粉900跌20, 罗伊山块975跌10; 天津港纽曼粉930跌15, 京唐港纽曼粉935跌5, 连云港PB粉900跌20, 青岛港PB粉900跌20, 岚桥港PB粉900跌15。

7月18日, 新闻称CSN(COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL)将与嘉能可(Glencore)签订铁矿石供应合同, 直至今天, CSN正式通知其股东和市场, 子公司CSN Minerá与嘉能可达成共识, 签订铁矿石长期供应合同。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

7/18, 螺纹开盘 4038, 盘中最低 3966, 尾盘报收 3968; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3990 元/吨; 天津: 3960 元/吨, 相比上交易日-10/-10, 基差 22, 现货下跌至期货贴水收窄, 唐山钢坯 3650 元/吨, 与昨日+0, 盘面利润(理论) 281.86; 长流程利润快速下降, 电弧炉(成本偏高地区)模拟利润转为亏损, 经济参考报, 钢铁将行业企业分为 A、B、C 级, 在京津冀及周边、长三角区域、汾渭平原等环保重点区域, 根据不同天气条件, 根据等级采取不同的停限产措施。统计局公布 6 月份粗钢日均产量为 291.77 万吨, 环比增长 1.52%, 再创下历史新高。6 月钢筋产量为 2269.3 万吨, 同比大幅增长 29.4%。消费进入季节性淡季, 但韧性犹存, 现货小幅下跌, 成交转淡, 成本附近有支撑, 但成交开始转淡, 盘面震荡为主。

铁矿石: 力拓发布 2019 年二季度产销报告, 报告显示: 产量方面: 2019 年第二季度, 皮尔巴拉业务铁矿石产量为 7970 万吨, 环比增加 5%, 同比减少 7%。需求方面: 华北: 需求持续低迷, 中低品价差拉大, 由于唐山及武安地区仍在严格执行限产政策, 对铁矿需求锐减, 港口现货成交偏低, 华东: 品种替代性增强, 矿价或小幅回调; 沿江区域市场价格基本呈现粉矿上涨块矿下跌趋势, 市场交投氛围较好。盘面冲高回落, 如前期没有多单持有, 还是以谨慎观望为主。

操作建议: 目前利润 350 附近, 螺纹盘面震荡上行, 短线区间操作, 或择机逢低做多卷螺差, 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	3990	-10			
	天津	3960	-10			
螺纹 10-01		313		3968	-84	22
盘面利润		281.86				
现货模拟利润		303.86				
热卷	上海	4050	-40			
	天津	3970	-50	3861	-	189
钢坯	唐山	3650	0			
铁矿 pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	901	-10	889	-10.5	12
		117.5				
二级焦炭	唐山	1850	0	-	-	-

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。