

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: 021-51557562

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

邢台 1029 家企业实行错峰生产，11 月 13 日从邢台市环保局获悉，今冬明春采暖季，邢台市对 1029 家工业企业实施差异化错峰生产。

11 月 15 日，唐山全年累计压减炼钢产能 500.25 万吨，据媒体消息，11 月 14 日，唐山市举行 2018 年钢铁行业去产能集中行动，全市共封存 3 家企业的 2 座 50 吨转炉、1 座 75 吨转炉，合计压减炼钢产能 206.25 万吨。至此，唐山市全年累计完成压减炼钢产能 500.25 万吨，炼铁产能 298 万吨，超出省达年度压减任务炼铁产能 17 万吨。

11 月 15 日，今日起郑州对工业企业实行秋冬季停产限产，钢铁企业限产 50%，据媒体消息，郑州市工信委相关负责人发布，郑州市钢铁、焦化、铸造、建材、有色金属、医药（农药）等行业，实施错峰生产。实施时间为 2018 年 11 月 15 日至 2019 年 3 月 15 日。钢铁行业：实施限产 50% 以上（含轮产）。

11 月 15 日，上午 8 点 30 分，唐山象屿正丰总库存 4.5 万吨，其中钢坯库存 4.3 万吨。另外 11 月 14 日早八点到 11 月 15 日早八点，总入库量为 0.29 万吨，其中钢坯 0.29 万吨，总出库量 0.38 万吨，其中钢坯 0.38 万吨。

铁矿石

11 月 14 日普氏 62% 铁矿石指数报 74.55 美元/吨，较前一交易日下跌 0.65 美元/吨，跌幅 0.86%，连续三日下跌。

11 月 15 日，9 月份秘鲁铁矿石产量上升，铁矿石产量为 90.8 万吨，增长 21%。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

11/15, 螺纹开盘 3941, 盘中最低 3859, 尾盘报收 3889; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4450 元/吨; 天津: 4330 元/吨, 相比上交易日 0/+10, 基差 561, 偏高, 期货下跌致期货贴水轻微扩大, 唐山钢坯 3690 元/吨, 与昨日+0; 盘面利润(理论) 379, 收窄; 采暖季, 邢台市对部分钢厂实施差异化错峰生产, 郑州钢铁企业限产 50%; 唐山共封存 2 座 50 吨转炉、1 座 75 吨转炉, 合计压减炼钢产能 206.25 万吨, 但产量同比较高; 贸易商成交量 18.92 万吨(环比均 15.8) 微回暖, 偏淡; 今日开始各地陆续进入停产检修, 1 至 10 月城镇固定资产投资同比 5.7% (预期 5.5%), 需求韧性犹在, 盘面高位震荡偏弱; 铁矿石上涨报收 513.5, 现货 pb 粉(湿基): 584; 到港总量为 2021.1 万吨(-222.2), 钢厂利润下降, 低品矿采购意愿增加, 进口矿平均可用天数 28 天(+1); 到港量减少, 可用天数增加, 支撑价格, 但高炉检修或对需求造成影响。

操作建议: 目前利润回落 400 附近, 螺纹高位震荡, 偏弱, 短线区间操作, 注意控制风险。铁矿石 480 支撑, 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	4450	0			
	天津	4330	10			
	螺纹01-05	379		3889	-48	561
	盘面利润	391.32				
现货模拟利润	952.32					
热卷	上海	4040	-40			
	天津	3940	-50	3622	5	418
	热卷01-05	195				
钢坯	唐山	3690	0			
铁矿 pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	584	0	513.5	1.5	70.5
	铁矿09-01	31.5				
二级焦炭	唐山	2615	0	2382	31	233

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。