

# 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: 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

2月12日,钢谷网统计的31家流通商建材成交量总计5286.537吨,分区域来看,西北地区(20家)成交量总计4244.561吨,西南地区(11家)成交量总计1041.976吨。

2月12日,淡水河谷内部文件显示,淡水河谷早在2018年10月份就知晓,Brumadinho矿坝存在显著的决堤风险。按相关要求,淡水河谷10月份对Brumadinho大坝的风险归类评估应该通知到CEO和董事会。

2月12日,对冲研投讯,全国钢材总库存量966.94万吨较节前环比增加340.33万吨(+54.31%)包含38个城市,共计141个仓库。建筑钢材库存总量585.82万吨较节前环比增加225.98万吨(+62.80%)包含30个城市,共计77个仓库。全国热卷库存总量238.16万吨较节前环比增加89.37万吨(+60.06%)包含17个城市,共计54个仓库。全国中厚板库存总量50.73万吨较节前环比增加15.84万吨(+45.40%)包含10个城市,共计20个仓库。全国冷轧涂镀库存总量92.23万吨较节前环比增加9.14万吨(+11.00%)包含7个城市,共计16个仓库。

### 铁矿石

2月12日,惠誉解决方案:受淡水河谷事件影响,将铁矿石价格预期由60美元/吨上调至75美元/吨。

2月12日,据Mysteel,1/28-2/3到港量数据:全国26港到港总量为2184.1万吨,环比增加275.2万吨;北方六港到港总量为1101.1万吨,环比增加407.8万吨;全国26港主流高品澳粉到港472.3万吨,环比减少63.3万吨,主流低品澳粉到港290.9万吨,环比增加87.3万吨,主流澳块到港227.1万吨,环比减少21.3万吨;

2月12日,Metalloinvest2018年第四季度铁矿石产量为1034万吨环比增加3.5%。

# 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

## 二. 行情分析

2/12, 螺纹开盘 3818, 盘中最低 3771, 尾盘报收 3785; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3860 元/吨; 天津: 3880 元/吨, 相比上交易日+40/+0, 基差 75, 偏低, 现货上涨致期货贴水扩大, 唐山钢坯 3520 元/吨, 与昨日+10, 盘面利润(理论) 467.32; 春节期间高炉开工率 77.24% (-0.35%), 螺纹周产量或继续小幅下降; 冬储进行中, 厂/社库双增; 产量持续减少, 冬储进行, 盘面震荡上行; 铁矿石下跌至 634, 现货 pb 粉(湿基): 685 (+15); 惠誉受淡水河谷事件影响, 将铁矿石价格预期由 60 美元/吨上调至 75 美元/吨, 到港总量为 2184.1 万吨 (+275.2), 日均疏港高位; 铁矿减产预期再次上升, 总供需平衡受影响, 供应偏紧或成主导, 短期内对盘面影响极大, 盘面高位震荡。

操作建议: 目前利润回升至 500 附近, 螺纹盘面震荡上行, 短线区间操作, 或择机逢低正套 05-10 (248), 注意控制风险。铁矿石受淡水河谷尾矿坝泄漏影响, 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	3860	40	3785	-40	75
	天津	3880	0			
螺纹05-10		248				
盘面利润		467.32				
现货模拟利润		542.32				
热卷	上海	4020	-40	3674	-35	346
	天津	4000	-50			
热卷05-10		177				
钢坯	唐山	3520	10			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	685	15	634	-18	51
		铁矿05-09				
二级焦炭	唐山	1965	0	2100.5	4	-135.5

## 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。