

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

3月4日, 据卓钢快讯, 接邯郸环保局口头通知: 邯郸当地管厂今日生产线全停, 此次停限产政策执行一个月, 此次停限产一是响应环保要求, 缓解重污染天气; 二是响应“两会”; 还有少部分因素是用电量的影响。据知情人士反馈, 何时恢复生产, 一是看环保局通知; 二看天气, 正常来看, 全停一个月的可能性不大, 特别是焊管生产线。镀锌生产线部分限产一个月还是有可能的, “两会”之后, 生产线陆续全部复产的可能性大。今日邯郸主流管厂全部停产, 预计单天影响产量 1.4 万吨左右, 何时复产需等环保局通知

3月4日, 北京市生态环境局3日发布消息称, 2日夜间至3日白天, 北京市PM2.5浓度水平缓慢上升至“5级重度污染”, 京津冀区域污染态势稳定, 污染程度持续较重。预计5日, 受西北冷高压影响, 北京市空气质量将逐渐好转。国家大气污染防治攻关联合中心2日晚称, 本次重污染过程影响范围较大, 污染程度较重, 京津冀及周边的大范围地区普遍处于较重的空气污染水平; 华北地区普遍面临地面低压带、偏南风、较高湿度与强逆温静稳等的明显不利气象条件, 造成区域污染水平明显上升。

截至3月4日上午8点30分, 唐山象屿正丰总库存 33.4 万吨, 其中钢坯库存 31 万吨。另外3月3日早八点到3月4日早八点, 总入库量为 0.95 万吨, 其中钢坯 0.81 万吨, 总出库量 0.38 万吨, 其中钢坯 0.3 万吨。

铁矿石

3月1日, 普氏 62%铁矿石指数报 87.30 美元/吨, 较前一交易日上涨 2.50 美元/吨, 涨幅 2.95%, 连续两日上涨。

3月4日, 2月份, 巴西铁矿石出口量为 2890 万吨, 同比增长 21.6%; 出口价格为 52.9 美元/吨, 与去年同期持平。出口额为 15.3 亿美元, 增长 21.6%。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

3/4, 螺纹开盘 3815, 盘中最低 3787, 尾盘报收 3811; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3880 元/吨; 天津: 3930 元/吨, 相比上交易日+20/+30, 基差 69, 偏小, 现货上涨致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3500 元/吨, 与昨日+10, 盘面利润(理论) 527.77; 产业置换升级进行中, 吨钢利润本周持续扩大, 生产动力充足, 唐山持续污染橙色预警, 钢厂按评级错峰生产, 分别为 40%-50%、60%、70%以上烧结机、竖炉及白灰窑装备停产, 但螺纹周产量 324.65 万吨, 环比增加 15.66; 厂/社分化, 厂库销库, 社库持续垒库; 基差收窄至 100 附近, 现货维持 3800 附近; 京津冀地区环保升温, 产量温和变动, 需求预期上升, 目前盘面震荡回调, 重点关注后续需求; 铁矿石上涨至 620.5, 现货 pb 粉(湿基): 635 (+3); 澳/巴发货总量为 2247.3 万吨, 环比减少 39.1 万吨; 钢厂利润维持高位, 采购意愿持续增加, 日均疏港总量 292.31, 环比增 9.01, 继续超 280, 继前期矿价受矿难影响过高后, 钢厂采购开始回暖; 库存为 14687.73, 环比上周增 111.23, 持续垒库; 发货量小幅减少, 疏港量高位维持, 销库幅度较小, 目前高位震荡。

操作建议: 目前利润回升至 500 附近, 螺纹盘面震荡回调, 短线区间操作, 或择机逢低正套 05-10 (216), 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	3880	20			
	天津	3930	30			
螺纹05-10		217		3811	-4	69
盘面利润		527.77				
现货模拟利润		596.77				
热卷	上海	4010	-40			
	天津	3960	-50	3791	-34	219
热卷05-10		219				
钢坯	唐山	3500	10			
铁矿pb(湿基)	华北(曹妃甸)	635	13	620.5	-5	14.5
铁矿05-09		36				
二级焦炭	唐山	2065	0	2107.5	-60.5	-42.5

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。