

# 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

12月10日,河北胜宝钢铁产能退出,根据河北省政府钢铁产业政策要求,河北胜宝钢铁产能全部退出,据最新消息7日开始企业正式停产。河北胜宝年钢铁产能450万吨,主要生产热轧带钢、冷轧带钢、镀锌带钢及钢管等产品;此次高炉停产主要影响钢坯和热轧带钢,镀锌带钢及钢管仍正常生产。

12月10日,根据河南省区域环境空气质量预报,预测郑州市2018年12月9日起将经历一次重污染过程,空气质量以中重度污染为主。经研究,于2018年12月7日20时发布重污染天气黄色预警,12月8日20时启动III级应急响应。采取以下响应措施。

12月10日,根据太原市气象、环保部门研判会商,未来4天太原市气象条件不利于污染物扩散,污染物浓度将持续维持在较高水平。根据《太原市重污染天气应急预案》有关规定,经市重污染天气应急指挥部批准,决定发布重污染天气橙色预警,同时启动重污染天气应急预案橙色(二级)响应(12月8日12时-12月12日24时)。

12月10日,冶金工业规划研究院院长李新创在“2019年中国和全球钢铁需求预测研究成果暨钢铁企业竞争力评级”发布会上表示,预计2018年我国钢材需求量为8.2亿吨,同比增长12.6%;粗钢产量为9.23亿吨,同比增长11%。2019年钢材需求量为8亿吨,同比下降2.4%;粗钢产量为9亿吨,同比下降2.5%。

12月10日,唐山市启动重污染天气II级应急响应,据钢联,根据省环境应急与重污染天气预警中心和中国环境监察总站、省环境气象中心最新会商,12月9日-12月31日,我市持续受偏南风影响,湿度增大,逆温明显,扩散条件逐渐转差,将经历3轮不同程度的污染过程,按照河北省环境应急与重污染天气预警中心《关于建议做好近期空气重污染过程应对工作的函》要求,市重污染天气应对指挥部决定自2018年12月9日12时至12月31日24时,全市启动重污染天气II级应急响应(如需延长应急响应,另行通知)。

### 铁矿石

12月7日,普氏62%铁矿石指数报66.95美元/吨,较前一交易日上涨0.85美元/吨,涨幅1.29%,止步两连跌。

# 钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

## 二. 行情分析

12/10, 螺纹开盘 3388, 盘中最低 3303, 尾盘报收 3312; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3880 元/吨; 天津: 3600 元/吨, 相比上交易日-40/-30, 基差 568, 偏高, 现货下跌致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3310 元/吨, 与昨日-20; 盘面利润(理论) 210.38; 据钢铁产业要求, 河北胜宝钢铁产能全部退出; 太原、郑州等地环保预警响应, 唐山市启动重污染天气 II 级应急响应, 钢厂分级限产, 但产量同比偏高; 厂/社库双降, 但变动幅度偏小。供应量偏高, 雨雪南下影响汽运, 需求减弱, 盘面窄幅震荡, 偏弱; 铁矿石上涨至 473.5, 现货 pb 粉(湿基): 537 (+4); 矿山发货量继续下降, 日均疏港量下降至 268.82 万吨(-7.41), 库存 13860.02 (-174.9); 补库意愿较低, 成交下滑, 但到港压力稍缓, 销库温和, 目前跟随钢价企稳, 宽幅震荡。

操作建议: 目前利润 200 附近, 螺纹盘面企稳, 窄幅震荡偏弱, 短线区间操作, 或择机逢高反套 01-05, 注意控制风险。铁矿石宽幅震荡, 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	3880	-40			
	天津	3600	-30			
螺纹05-10		139		3312	-85	568
盘面利润		210.38				
现货模拟利润		778.38				
热卷	上海	3970	-40			
	天津	3760	-50	3281	-64	689
热卷05-10		127				
钢坯	唐山	3310	0			
铁矿pb(湿基)华北(曹妃甸)		537	4	473.5	-1.5	63.5
铁矿05-09		20.5				
二级焦炭	唐山	2165	0	2371.5	-60.5	-206.5

## 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。