

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

5月28日,河北省委书记、河北省人大常委会主任王东峰28日表示,河北的钢铁在国际上是一流水平,是过剩产能,不是落后产能。我们原则是“关小促大、保优压劣”,现在总量还比较大,今明两年再分别压减1400万吨,到2020年控制在2亿吨以内。

5月28日,据河北日报,河北省统计局数据显示,一季度,河北省钢铁行业完成技改投资同比增长51.5%,增速位居七大主导行业首位。

5月28日,据世界钢铁协会消息,2019年4月全球纳入世界钢铁协会统计国家的粗钢产量为1.567亿吨,同比提高6.4%。2019年4月中国粗钢产量为8500万吨,同比提高12.7%。印度4月粗钢产量为880万吨,同比提高1.5%。日本4月粗钢产量860万吨,同比下降0.8%。韩国4月粗钢产量为600万吨,同比提高1.4%。

铁矿石

5月28日,据巴西Minas Gerais州公诉人:目前,淡水河谷位于当地关键的Brucutu铁矿石矿场将保持部分关闭状态。由于矿场尚未招聘外部审计机构来评估各方对矿场的安全担忧,该矿场不会迅速恢复完全的产能。

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

5/28, 螺纹开盘 3835, 盘中最高 3870, 尾盘报收 3845; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 4060 元/吨; 天津: 4030 元/吨, 相比上交易日-10/+0, 基差 215, 现货下跌致期货贴水轻微收窄, 唐山钢坯 3620 元/吨, 与昨日+0, 盘面利润(理论) 303.09; 废钢利用率大幅提升, 而且电炉产能已经修复缺口的同时, 纯废钢电炉仍有利润, 供应水平已在高位, 本周螺纹周产量 381.52 万吨, 较上周增加 3.16 万吨; 螺纹社库 569.83 万吨, 周环比减少 27.86 万吨, 厂库 204.44 万吨, 周环比减少 10.4 万吨, 去库继续放缓; 现货淡季涨价压力依然较大, 短期盘面整理可能性高。根据当前产能利用率及废钢添加比例情况, 钢材高产量有望震荡走平, 淡季不淡下整体降库在 6 月前延续, 盘面高位震荡。

铁矿石供应上, 近期发货有所回升但仍低于往年同期, 高炉产能利用率、日耗、疏港等需求数据仍均处高位, 整体港库、厂库及可用天数延续低位下降状态叠加汇率因素, 对进口铁矿石构成支撑。关注巴西矿复产情况对铁矿供给的影响, 中长期预计供需面依然偏紧。业内: 港口直接感受来看, 有的品种已经非常稀缺, 如山东的港口缺少巴粗等, 金布巴前两周也很紧张, 可贸易资源不到 10 万吨, 盘面震荡上行。

操作建议: 目前利润 300 附近, 螺纹盘面震荡, 短线区间操作, 注意控制风险。铁矿石震荡上行, 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	4060	-10	3845	3	215
	天津	4030	0			
螺纹10-01		296				
盘面利润		303.09				
现货模拟利润		518.09				
热卷	上海	4190	-40	3669	-	521
	天津	4020	-50			
钢坯	唐山	3620	0			
铁矿pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	775	32	756.5	-4.5	18.5
		铁矿05-09	60.5			
二级焦炭	唐山	2050	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。