

铁矿石、螺纹钢日报

兴证期货·研究发展部

2017年9月4日星期一

黑色研究团队

李文婧

投资咨询资格编号: Z0010649

期货从业资格编号: F3024409

021-20370977

liwj@xzfutures.com

孙二春

投资咨询资格编号: Z0012934

期货从业资格编号: F3004203

021-20370947

sunec@xzfutures.com

韩惊

投资咨询资格编号: Z0012908

期货从业资格编号: F3010931

021-20370949

hanjing@xzfutures.com

后市展望及策略建议:

螺纹钢: 周末唐山钢坯涨 70 元/吨, 预计本日期螺高开。上周出炉数据 8 月中旬粗钢产量表内历史新高, 库存回升, 上海线螺销售减少。但高炉连续三日事故使得市场气氛非常乐观。建议投资者观望为主。仅供参考。

市场消息:

1. 近日, 环保部印发《京津冀及周边地区 2017-2018 年秋冬季大气污染综合治理攻坚行动强化督查方案》(以下简称“《方案》”)。《方案》指出, 为进一步保障京津冀及周边地区秋冬季环境空气质量, 更加深入推进大气环境执法检查工作, 环保部将于 2017 年 9 月 1 日至 2018 年 3 月 29 日, 分两个阶段共 15 轮次, 对京津冀大气污染传输通道城市(“2+26”城市)的大气污染综合治理任务(清单见督查内容)进行督查。
2. 9 月 2 日中午, 市场传言, 位于河北廊坊的河北胜宝钢铁集团于今天发生一起高炉事故。具体为, 其 1080 立方米的高炉铁水出口爆炸引起燃气管道爆炸, 高炉 2000 吨铁水、焦炭全部泄漏。经济观察网记者随后通过胜宝钢铁集团官网的电话联系到相关人员, 对方向经济观察网表示, 胜宝钢铁并无高炉发生事故, 市场传言不实。
3. 中钢协副秘书长王颖生日前在论坛活动上表示, 兼并重组是钢铁行业下一步的重点任务, 未来行业重组会逐步提高。另有消息人士透露, 随著东北特钢的债转股方案落地通过, 东北地区钢企整合有望先行一步, 且未来不排除仍由鞍钢实现东北地区的钢企大整合。但整合时间表可能比较长, 很难在下半年见到大规模的整合潮。
4. 供给侧结构性改革见效: 28 家上市钢企, 中期业绩大增近 5 倍。

行情回顾:

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1801	583	10	1689100	-19650
焦炭 1801	2341	-4	265694	-11134
螺纹钢 1801	4062	135	4618786	235666

数据来源: Wind

现货价格:

	最新价	变动
铁精粉:湿基不含税出厂价:唐山: 66%	535	0
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	635	5
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	590	10
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	585	10
钢坯: Q235: 唐山	3770	50
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	4120	90
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4110	110
螺纹钢: HRB400 20MM: 唐山	3960	60

数据来源: Wind, 我的钢铁网

期现价差:

	期货收盘价	现货		期货-现货
I1801	583	普氏指数	折算	-60.41
		77.1	643.41	
RB1801	4062	上海螺纹钢	折算	-185.42
		4120	4247.42	

仓单:

品种	仓单量	变动
铁矿石:手	0	0
焦炭:手	0	0
螺纹钢:吨	4150	0

数据来源: 上期所, 大商所

新加坡铁矿石掉期:

	最新价	变动
新加坡铁矿石掉期: 9月合约	78	1.15
新加坡铁矿石掉期: 1月合约	72.95	1.05

数据来源: Bloomberg

分析师承诺

本人以勤勉的职业态度,独立、客观地出具本报告。本报告清晰准确地反映了本人的研究观点。本人不曾因也将不会因本报告中的具体推荐意见或观点而直接或间接接收到任何形式的报酬。

免责声明

客户不应视本报告为作出投资决策的惟一因素。本报告中所指的投资及服务可能不适合个别客户,不构成客户私人咨询建议。本公司未确保本报告充分考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。本公司建议客户应考虑本报告的任何意见或建议是否符合其特定状况,以及(若有必要)咨询独立投资顾问。

在任何情况下,本报告中的信息或所表述的意见并不构成对任何人的投资建议。在任何情况下,本公司不对任何人因使用本报告中的任何内容所引致的损失负任何责任。