

铁矿石、螺纹钢日报

兴证期货·研究发展部

2017年9月5日星期二

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: 黑色系夜盘集体走低, 螺纹窄幅震荡。高炉事故带来的短期利多氛围基本释放, 后续关注是否会有停产检修的预期, 建议投资者观望为主, 仅供参考。

铁矿石: 铁矿石夜盘低开震荡。铁矿石近期港口库存略有下降, 但仍维持高位; 后期停产检修的预期或在需求端对铁矿石形成压制。建议投资者观望为主, 仅供参考。

市场消息:

1. 中钢和力拓集团于当地时间8月29日在澳大利亚珀斯举办庆典活动。在庆典活动中, 中钢与力拓共同公布, 双方已就恰那合营项目的第三次续约签署了框架协议。本次续约将使恰那铁矿的总产量再增加1000万吨, 累计产量提至2.9亿吨, 该项目的联合运营期也将延至2020年。
2. 在2017金砖研讨会上, 中国商务部副部长王受文表示, 过去十年中, 金砖国家在世界经济的比重已经从12%上升到23%。WTO规则司司长休曼提供了另一组数据: 伴随着经济的快速发展, 金砖五国也已成为贸易救济政策的重点。仅2016年, 45%的反倾销调查、71%的反补贴调查, 均针对金砖五国。根据美国国际贸易委员会数据, 截至2017年6月28日, 52%的双反(反倾销和反补贴)措施是关于钢铁制品。这其中, 61%针对金砖五国。
3. 从9月1日开始, 环保部针对“2+26”城市将开展“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: 环保部28个督查组将采取独立督查方式, 原则上不需地方各级环保部门陪同; 环保部将派出由“正规军”组成的102个巡查工作组进驻京津冀大气污染传输通道的“2+26”所有城市, 开展为期4个月的日常化巡查。
4. 京煤集团2016年关闭两座煤矿, 在全国率先验收, 到2020年, 其将关闭所有5座煤矿, 这意味着北京800年的采煤史将走向终结。此外, 北京在钢铁等其他领域的去产能进展也较大。根据近期通报, 北京市化解粗钢产能210万吨, 实施金隅股份和冀东集团两大水泥企业重组, 退出“僵尸企业”55户。

行情回顾:

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1801	565.5	-17.5	1664356	-24744
焦炭 1801	2284	-57	270640	4946
螺纹钢 1801	4060	-2	4402032	-216754

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%	645	10
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	600	10
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	598	13
钢坯: Q235: 唐山	3800	30
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	4180	60
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4190	80
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	4040	80

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	565.5	普氏指数	折算	-80.69
		77.45	646.19	
RB1801	4060	上海螺纹钢	折算	-249.28
		4180	4309.28	

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	76.97	-0.63
新加坡铁矿石掉期: 1月合约	72.03	-0.57

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。