

铁矿石、螺纹钢日报

兴证期货·研究发展部

黑色研究团队

2017年10月23日星期一

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

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:

兴证点钢: 上周期螺走势振幅较大,周一冲高到周四后,周五受到库存大降影响,有所反弹。但升幅又被周五晚间跌回。我们认为目前时点上略强的供需可能只是季节性的。取暖季限产对供需的影响尚未体现。建议投资者前期空单持有。观察取暖季限产事实。仅供参考。

兴证铁矿: 铁矿石上周五震荡盘整。目前铁矿石港口库存处于高位,外矿发货回暖,铁矿石供应压力较大;同时随着环保限产政策的推进,钢厂补库积极性不高,后期需求量或进一步受到影响,铁矿石供大于求的局面未有改观;铁矿石反弹空间或将有限,建议投资者暂时观望,等待后续逢高沽空的机会。

市场消息:

1. 统计局:经初步核算,三季度GDP为21.18万亿元人民币,同比增6.8%;前三季度GDP为59.33万亿元人民币,同比增6.9%;三季度GDP中金融业同比增长5.6%,二季度同比增长3.2%;房地产业同比增长3.9%,二季度同比增长6.2%。
2. 央行:9月末,金融机构人民币各项贷款余额117.8万亿元,同比增长13.1%,增速比上季末高0.2个百分点;1-9月增加11.2万亿元,同比多增9980亿元。
3. 在百亿大拍卖因“无人报名”而失效之后,重庆钢铁重启了这一资产拍卖进程。10月22日,记者自人民法院诉讼网获悉,重庆钢铁将其所有的二炼钢、棒线、型钢等资产以及部分房产挂牌拍卖,起拍价合计略超40亿元,相比于第一次拍卖缩水六成。
4. 国资委主任肖亚庆表示,将进一步加强国资监管的针对性、有效性和系统性;在企业改制重组、产权交易、重大投资等一些重点环节和领域,国资委则有针对性地强化了监督力度。

行情回顾:

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1801	469	25	2690972	-44034
焦炭 1801	1762.5	75.5	302430	-13682
螺纹钢 1801	3776	172	4084084	-51422

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%	470	0
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	515	-10
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	460	-5
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	460	-5
钢坯: Q235: 唐山	3660	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	3930	30
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4010	50
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	3830	40

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	469	普氏指数	折算	-43.53
		60.65	512.53	
RB1801	3776	上海螺纹钢	折算	-275.55
		3930	4051.55	

数据来源: Wind

仓单:

品种	仓单量	变动
铁矿石:手	0	0
焦炭:手	0	0
螺纹钢:吨	45872	-2395

数据来源: 上期所, 大商所

三大铁矿石指数:

	最新价	变动
普氏:62%	60.65	1.2
TSI:62% (滞后一期)	59.6	-2.1
MBIO:62%	62.46	1.58

数据来源: Wind

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唯一因素。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。