

# 铁矿石、螺纹钢日报

兴证期货·研发中心

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

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

2017年10月30日星期一

## 后市展望及策略建议:

**兴证点钢:** 周末钢坯价格先跌后涨, 基本小幅波动。上周现货旺季销售好转, 但货源增加, 现货走势较为坚挺。预期偏弱致使期螺大幅下行。建议投资者持空。仅供参考。

**兴证铁矿:** 铁矿石上周五下跌。目前铁矿石库存处于高位, 并且随着外矿发货的持续回暖, 预计库存后期仍有上升趋势。另一方面, 受环保限产的影响, 钢厂矿石日耗及库存上周继续下降, 预期后期维持低库存运行; 目前铁矿石供过于求的局面未有改观。预计短期铁矿震荡为主, 建议投资者暂时观望, 等待后续逢高沽空的机会, 仅供参考。

## 市场消息:

1. 9月规模以上工业企业实现利润总额6621.8亿元, 同比增27.7%, 前值增24%; 1-9月规模以上工业企业利润同比增22.8%, 增速比1-8月份快1.2个百分点; 统计局: 工业利润增速进一步提高; 前三季度工业企业效益明显好转, 运行质量提升。
2. 10月份已接近尾声, 食用农产品价格涨幅基本平稳。不少机构对10月份CPI和PPI进行预测, 较多机构认为, 今年10月份CPI同比涨幅可能在1.7%至1.9%之间, 取中值为1.8%, 涨幅相比上月有小幅回升。
3. 日前, 我国制造的世界最大矿砂船——新一代超大型40万吨矿砂船在青岛下水, 成为了中国船舶业转型升级的新标杆。据了解, 我国总共将建造30艘新一代超大型40万吨矿砂船, 分由国内四家船厂制造, 宝钢股份精品厚板EH36将为新一代超大型矿砂船撑起核心部位。
4. 10月28日, 宝钢股份发布2017年三季度业绩报告。报告显示, 前三季度, 宝钢股份营业收入达到2518.37亿元, 同比增长43.12%, 归属于上市公司股东的净利润116.68亿元同比增长95.52%。2017年上半年, 宝钢股份归属于上市公司股东的净利润为61.7亿元, 这意味着, 宝钢股份仅2017年第三季度归属于上市公司股东的净利润就接近55亿元。

## 行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1801	428	-25.5	2780534	231808
焦炭 1801	1731	9	294062	-22080
螺纹钢 1801	3577	-73	4112304	106214

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	-5
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	472	-5
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	470	-3
钢坯: Q235: 唐山	3700	-40
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	3930	-20
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4000	-10
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	3860	0

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
		普氏指数	折算	
I1801	428	59.1	500.20	-72.20
RB1801	3577	上海螺纹钢	折算	-474.55
		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	27379	-2376

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%	59.1	-3.2
MBIO:62%	60.08	-1.39

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。