

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11月1日星期三

后市展望及策略建议:

兴证点钢: 期螺夜间小幅回落, 期卷夜间回落幅度较大吞没昨日涨幅。唐山环保督察再起, 市场多头氛围酝酿。但宏观数据转差, 预期转差, 期钢反弹艰难。建议前空持有。仅供参考。

兴证铁矿: 铁矿石隔夜弱勢震荡。昨日铁矿石现货价格小幅走低, 贸易商对于中低品位矿石挺价意愿较强。全国 45 个港口铁矿石库存为 13660 万吨, 较上周五数据增 66 万吨, 后期仍有继续上升的压力, 整体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:

- 10月官方制造业 PMI 为 51.6, 比上月回落 0.8 个百分点; 10月官方非制造业 PMI 54.3, 前值 55.4。统计局: 制造业和非制造业持续保持扩张发展态势; 生产和市场需求增速有所放慢; 高耗能、高污染行业生产经营活动趋缓; 高端制造业、消费品相关制造业增长动能持续释放。
- 在日前召开的第 9 届中日钢铁业环保节能先进技术专家交流会上, 中国钢铁工业协会副会长迟京东透露, 目前中国解决了钢铁产能严重过剩矛盾: 淘汰了落后产能近 9500 万吨, 化解过剩产能近 1.2 亿吨, 彻底清除 1.4 亿吨地条钢。
- 河北环保厅厅长高建民 10 月 31 日表示, 截至目前, 今年河北省已淘汰燃煤小锅炉 3.36 万台 5.05 万蒸吨; 完成压减炼铁产能 2022 万吨、炼钢产能 2261 万吨。
- 日前, 京津冀三地环保部门加强大气污染监管和环境执法联动, 落实环保部日前出台的《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方案》。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1801	428	3	2683430	-278
焦炭 1801	1724.5	-6.5	290102	-3960
螺纹钢 1801	3628	57	4161614	150688

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%	500	-10
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	457	-5
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	455	-5
钢坯: Q235: 唐山	3690	10
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	3930	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	3990	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	3840	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
I1801	428	普氏指数	折算	-75.38
		59.5	503.38	
RB1801	3628	上海螺纹钢	折算	-423.55
		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	20257	-5051

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%	59.5	0.5
TSI:62% (滞后一期)	58	-0.7
MBIO:62%	0	-58.75

数据来源：Wind

新加坡铁矿石掉期：

	最新价	变动
新加坡铁矿石掉期：1月合约	58.7	+1.05
新加坡铁矿石掉期：3月合约	58.6	+1.1

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。