

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8日星期三

后市展望及策略建议:

兴证铁矿: 铁矿石隔夜收跌, 现货价格持稳, 成交一般。昨日铁矿石库存与上周五相比小幅走高, 同时受政策的影响, 港口疏港量下降幅度较大。目前来看, 铁矿石港口库存处于高位, 环保亦影响了需求, 整体基本面仍然较差, 建议投资者暂时观望, 等待逢高沽空的机会, 仅供参考。

市场消息:

1. 中国 10 月外汇储备升至 3.1092 万亿美元, 创 2016 年 10 月以来新高, 连续 9 个月上涨, 前值 3.1085 万亿美元; 黄金储备 752.38 亿美元, 9 月末为 760.05 亿美元。外管局: 10 月外汇供求处于基本平衡状态, 跨境资金流动和国际收支保持平衡有序的基础将更加坚实, 未来外储规模逐步回升后有望保持总体稳定。
2. 日前, 沙钢与江苏成安基金公司在沙钢宾馆签署废钢收购战略合作协议, 一次性签订了 40 万吨废钢采购合同。
3. 近日, 多年巨亏的 * S T 重钢再度公告, 通过市场化比较, 最终确定由四源合 (上海) 钢铁产业股权投资基金中心 (有限合伙) 及重庆战略性新兴产业股权投资基金合伙企业共同设立的“重庆长寿钢铁有限公司”为公司重组方, 对公司进行重整, 并签订《对重庆钢铁股份有限公司投资之框架协议》。
4. 据商务部监测, 上周 (10 月 30 日至 11 月 5 日) 钢材价格下降 0.2%, 其中槽钢、普通中板、热轧带钢、高速线材价格分别为 4238 元/吨、4190 元/吨、4137 元/吨和 4159 元/吨, 分别下降 0.8%、0.5%、0.4% 和 0.2%。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1801	469	1	2604734	-84446
焦炭 1801	1831	40.5	268978	-26146
螺纹钢 1801	3707	-29	3985084	-154864

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%	505	5
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	475	10
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	473	10
钢坯: Q235: 唐山	3660	50
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	4030	20
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4090	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	3900	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	469	普氏指数	折算	-66.2
		63.5	535.21	
RB1801	3707	上海螺纹钢	折算	-447.6
		4030	4154.64	

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	15777	-299

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%	63.5	-0.4
TSI:62% (滞后一期)	62.7	3.3
MBIO:62%	62.66	-0.7

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	62.35	-0.45
新加坡铁矿石掉期: 3月合约	62.85	-0.25

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。