

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9日星期四

后市展望及策略建议:

兴证铁矿: 铁矿石隔夜偏强震荡, 现货价格持稳。受港口检修影响, 上周外矿发货量回落, 但高品位粉矿受到的影响不大; 另一方面受环保限产影响, 目前钢厂补库积极性不高, 仍以按需采购为主。矿石整体基本面仍然较差, 短期反弹空间或有限, 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. 按人民币计, 中国 10 月进口同比增 15.9%, 前值增 19.5%; 出口同比增 6.1%, 前值增 9%; 贸易顺差 2544.7 亿, 前值 1930 亿。按美元计, 进口同比增 17.2%, 前值由增 18.7% 修正为 18.6%; 出口同比增 6.9%, 前值增 8.1%; 贸易顺差 382 亿, 前值 285 修正为 286.1 亿。10 月外贸出口先导指数为 41.6, 较上月下滑 0.2。
2. 11 月 7 日, 河北省政府新闻办举行“大气污染治理和节能减排工作”新闻发布会。河北省发展和改革委员会副主任张国洪表示, 河北省去产能任务取得显著成效。2013-2017 年 9 月, 全省累计压减炼钢产能 6993 万吨、炼铁 6442 万吨, 钢铁冶炼厂点由 148 个减至 87 个, 企业由 125 家减至 69 家, 提前超额完成国家下达任务。
3. 据央视新闻消息, 11 月 6 日 15 时, 隶属中国五矿集团的邯邢矿业有限公司西石门铁矿因发生井下不明原因造成的有害气体中毒事故, 导致 9 人中毒, 其中 1 人获救, 8 人经抢救无效死亡。五矿集团回复称, 对没能挽留住职工的生命表示非常痛心, 对死者家属深表致歉和慰问。目前正全力以赴和相关部门一道做好事故调查和善后等工作, 西石门铁矿为了全体矿工的安全考虑已经停产, 直到查明原因。有进一步消息, 中国五矿也将及时对外公布。
4. 据海关总署消息, 2017 年 10 月份, 我国出口钢材 498 万吨, 较上月减少 16 万吨, 同比下降 35.3%; 1-10 月我国累计出口钢材 6449 万吨, 同比下降 30.4%。我国进口钢材 95 万吨, 较上月减少 29 万吨, 同比下降 12.0%; 1-10 月我国累计进口钢材 1096 万吨, 同比增长 0.5%; 10 月份我国进口铁矿砂及其精矿 7949 万吨, 较上月减少 2334 万吨, 同比下降 1.6%; 1-10 月我国累计进口铁矿砂及其精矿 89623 万吨, 同比增长 6.3%。10 月份我国出口焦炭 34 万吨, 较上月减少 13 万吨; 1-10 月我国累计出口焦炭 608 万吨, 同比下降 26.6%。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1801	466	-3	2602682	-2052
焦炭 1801	1867.5	36.5	270940	1962
螺纹钢 1801	3724	17	4019500	34416

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	0
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	475	0
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	473	0
钢坯: Q235: 唐山	3660	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	4030	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4080	-10
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
		普氏指数	折算	
I1801	466	63.05	531.63	-65.6
RB1801	3724	上海螺纹钢	折算	-430.6
		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	14578	-1199

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%	63.05	-0.45
TSI:62% (滞后一期)	62.3	-0.4
MBIO:62%	62.26	-0.4

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	63.8	1.45
新加坡铁矿石掉期: 3月合约	64.1	1.25

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。