

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16日星期四

后市展望及策略建议:

兴证铁矿: 铁矿石隔夜弱势震荡, 港口现货价格走弱。上周澳洲巴西发货量环比出现回升, 后期港口库存走高的压力仍然较大; 目前进入取暖季环保限产时期, 下游需求进一步趋弱。总体来看, 铁矿石基本面仍然较差, 建议投资者暂时观望, 仅供参考。

市场消息:

1. 发改委: 煤炭、商品房将是下一步价格监管重点; 要研究进一步促进新能源汽车发展的政策措施; 年底我国共享经济交易规模将达到 4.5 万亿元; 进一步放宽市场准入限制; 电商快递外卖等领域推行绿色物流实施方案正在研究。
2. 11月14日晚间, *ST重钢披露重整进展公告, 公司解散与韩国株式会社 POSCO 合资成立重庆重钢高强冷轧板材有限公司和重庆浦项重钢汽车板有限公司。此举将有利于重庆钢铁肃清历史包袱, 实现减重增效。
3. 按照国家发展改革委反垄断调查的有关要求, 近日上海国际港务(集团)股份有限公司、天津港(集团)有限公司、青岛港(集团)有限公司、宁波舟山港股份有限公司等港口企业先后进行整改, 规范生产经营行为, 维护公平竞争市场环境, 切实降低企业进出口物流成本, 促进实体经济减负增效。其中, 调降装卸作业费一项, 每年可降低进出口物流成本约 35 亿元。
4. 前不久, 国务院国企改革领导小组审议通过了第三批试点名单, 已确定将 31 家国有企业纳入第三批试点范围, 其中既有中央企业, 也有地方国有企业。目前, 试点企业正在制定实施方案。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1801	446	-18.5	2551562	-27904
焦炭 1801	1796.5	-46	251686	3442
螺纹钢 1801	3705	-99	3811896	-214218

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%	475	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%	473	3
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	473	3
钢坯: Q235: 唐山	3860	-10
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	4160	-10
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4160	-20
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	4030	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	446	普氏指数	折算	-75.7
		61.8	521.68	
RB1801	3705	上海螺纹钢	折算	-583.7
		4160	4288.66	

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	12796	-596

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%	61.8	-1.75
TSI:62% (滞后一期)	62.8	0.9
MBIO:62%	61.84	-1.33

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	61.45	0.15
新加坡铁矿石掉期: 3月合约	61.45	0.15

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。