

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12月7日星期四

后市展望及策略建议:

兴证点钢: 昨日夜间螺价格小幅震荡, 钢坯价格跌 50, 市场消息钢材社会库存继续下降, 但是高利润刺激铁水流入, 螺纹供需紧张有望缓解。建议空单持有。仅供参考。

兴证铁矿: 铁矿石隔夜低位震荡。昨日港口现货报价走低, 铁矿石成交转弱, 钢厂采购意愿下降。随着港口检修的结束, 上周澳洲巴西总发货量环比有较大幅度增加。目前铁矿自身基本面较差, 外矿发货回暖, 港口库存高位, 后期若要继续上涨还需钢材的带动。短期铁矿上涨幅度较大, 谨防调整回落风险。建议投资者暂时观望, 仅供参考。

市场消息:

1. 财政部网站 6 日公布的数据显示, 截至今年 10 月底, 全国 PPP 综合信息平台项目库已进入开发阶段的项目达 6806 个, 计划投资额 10.2 万亿元, 覆盖全国 31 个省(自治区、直辖市), 涉及市政、环保、教育、养老等 19 个行业领域。其中已落地项目 2438 个, 计划投资额 4.1 万亿元。
2. 12 月 4 日, 环保部大气污染强化督查、督查组共检查了河北省石家庄市、保定市、沧州市、衡水市、邢台市、邯郸市, 山西省太原市、晋城市以及河南省郑州市、开封市、新乡市、焦作市、鹤壁市、安阳市、濮阳市等 15 个城市的 564 个重污染天气橙色预警应急响应措施具体任务点位, 发现 9 家企业(工地)未严格落实重污染天气应急预案停产、限产。
3. 煤炭交易中心 6 日正式启动能源大数据平台, 这一平台收集整合了 1 万余家交易商的信息、结算和物流数据, 以及 530 类煤炭相关行业近八年的 2800 多万条数据, 初步构建起能源大数据平台的生态圈。
4. 郑商所: 近期影响硅铁、锰硅市场的不确定性因素较多, 价格波动较大, 请各会员单位切实加强投资者教育和风险防范工作, 提醒投资者谨慎运作, 理性投资。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1805	523	-16.5	2166132	-79578
焦炭 1805	2186	9	309102	13798
螺纹钢 1805	3916	-109	4033308	-81352

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%	490	5
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	560	0
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	530	-8
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	530	-8
钢坯: Q235: 唐山	3920	-50
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	4930	-50
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4960	-30
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	4520	-90

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	
I1805	523	69	578.96	-56.0
RB1805	3916	上海螺纹钢	折算	-1166.5
		4930	5082.47	

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	4192	0

数据来源：上期所，大商所

新加坡铁矿石掉期：

	最新价	变动
新加坡铁矿石掉期：3月合约	66.25	-2.05
新加坡铁矿石掉期：5月合约	65.1	-1.1

数据来源：Bloomberg

三大铁矿石指数：

	最新价	变动
普氏:62%	69	-3.15
TSI:62% (滞后一期)	70.8	-0.5
MBIO:62%	69.36	-2.41

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。