

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15日星期五

后市展望及策略建议:

兴证铁矿: 铁矿石隔夜偏弱震荡。昨日港口现货价格持稳,整体成交一般且以高品粉矿为主。受环保限产影响,高炉产能利用率处于偏低位置且继续小幅下滑,钢厂整体补库积极性仍然不高。另一方面铁矿石供应端压力仍然较大,港口库存处于高位且继续上升。建议投资者短期暂时观望,仅供参考。

兴证点钢: 昨日期螺大幅回落,螺纹钢现货价格下跌,步入12月以后需求逐步回落,钢材库存回落速度趋缓。建议投资者持空。仅供参考。

市场消息:

1. 2017年11月份,规模以上工业增加值同比实际增长6.1%,比10月份回落0.1个百分点。1-11月份,规模以上工业增加值同比增长6.6%。
2. 2017年1-11月份,全国固定资产投资(不含农户)575057亿元,同比增长7.2%,增速比1-10月份回落0.1个百分点。从环比速度看,11月份比10月份增长0.53%。
3. 1-11月份,全国房地产开发投资100387亿元,同比名义增长7.5%,增速比1-10月份回落0.3个百分点。1-11月份,商品房销售面积146568万平方米,增长7.9%,增速回落0.3个百分点。1-11月份,商品房销售额115481亿元,增长12.7%,增速提高0.1个百分点。1-11月份,房屋新开工面积161679万平方米,增长6.9%,增速提高1.3个百分点。11月末,商品房待售面积59606万平方米,比10月末减少653万平方米。
4. 2017年11月份,社会消费品零售总额34108亿元,同比名义增长10.2%。1-11月份,社会消费品零售总额331528亿元,同比增长10.3%。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1805	498	-8	2061444	-27208
焦炭 1805	1998	-70.5	297824	2062
螺纹钢 1805	3786	-45	3571054	-115642

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%	520	20
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	550	0
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	509	2
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	506	3
钢坯: Q235: 唐山	3950	-30
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	4830	-70
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	4850	-50
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	4530	-70

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	498	70.5	590.90	-92.9
RB1805	3786	上海螺纹钢	折算	-1193.4
		4830	4979.38	

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	3296	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	66.3	-0.85
新加坡铁矿石掉期：5月合约	65.1	-0.8

数据来源：Bloomberg

三大铁矿石指数：

	最新价	变动
普氏:62%	70.5	-0.55
TSI:62%（滞后一期）	69.7	0.1
MBIO:62%	69.94	-0.6

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。