

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

2018年1月29日星期一

后市展望及策略建议:

兴证铁矿: 铁矿石上周五弱势震荡。近期钢厂对铁矿石进行补库, 钢厂铁矿石库存上升较为明显, 同时部分钢厂仍有采购意愿, 市场成交转好。但目前铁矿石港口库存仍处高位, 同时后期钢厂继续大幅补库的空间有限, 总体来看铁矿石依然偏弱。短期建议投资者暂时观望, 等待沽空机会, 仅供参考。

市场消息:

1. 央行前首席经济学家马骏在昨日举办的复旦大学管理学院“2018 蓝墨水新年论坛”上表示, 预估 2018 年 GDP 增速将会从去年的 6.9% 放缓到 6.5%, 且未来几年预计将通过房产税立法。第一是未来将增加多主体供给, 包括土地供应增加和各种类型租赁房的增加; 第二是未来几年预计将通过房产税的立法, 此后在更多的城市推开。
2. 本周, 各省份陆续进入两会时间, 梳理信息发现, 各省份都不约而同地把供给侧结构性改革摆在重要位置, 其中不少省份把严防“地条钢”死灰复燃写入政府工作报告。
3. 从山西省国土资源厅获悉, 这个省近年来大力实施地质找矿行动, 过去 5 年累计新发现煤炭资源 104.98 亿吨, 远远超过同期煤炭产量。山西是中国煤炭大省, 素有“煤海”之称。自新中国成立至 2014 年底, 山西累计生产煤炭 162.7 亿吨, 占全国的 1/4, 净调出超过 110 亿吨, 占全国的 3/4。
4. 记者在河北省人大会议上获悉, 河北省将继续推进以产业结构调整为核心内容的转型升级, 在 2018 年年内还将压减钢铁产能 1000 万吨以上。河北省政府工作报告显示, 5 年来, 河北以化解钢铁产能为“牛鼻子”, “6643”工程超额完成, 累计压减炼钢产能 6993 万吨、炼铁产能 6442 万吨、水泥 7057 万吨、平板玻璃 7173 万重量箱, 压减煤炭消费量 4400 万吨。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1805	519	-10.5	2142432	30626
焦炭 1805	2041	-22.5	261652	-31770
螺纹钢 1805	3945	-21	3474148	-115204

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	-10
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	580	5
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	535	2
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	535	5
钢坯: Q235: 唐山	3600	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	3900	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	3940	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	4020	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	
I1805	519	74.6	583.68	-64.7
RB1805	3945	上海螺纹钢	折算	-75.6
		3900	4020.62	

数据来源：Wind

仓单：

品种	仓单量	变动
铁矿石:手	0	0
焦炭:手	0	-100
螺纹钢:吨	18034	0

数据来源：上期所，大商所

铁矿石相关指数:

	最新价	变动
普氏:62%	74.6	-0.45

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。