

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2月1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。昨日铁矿石港口现货实际成交价格及活跃度下滑。近期钢厂对铁矿石进行了一轮补库, 预计后期钢厂继续大幅补库的空间有限。目前铁矿港口库存处于历史高位, 总体来看依然偏弱。短期建议投资者暂时观望, 等待沽空机会, 仅供参考。

兴证点钢: 昨日有市场传言河北将延长取暖季限产, 但目前并没有正式文件出台。受消息影响期螺夜间上涨。建议投资者观望。仅供参考。

市场消息:

1. 中国1月官方制造业 PMI 为 51.3, 连续 18 个月站稳荣枯线上方, 前值为 51.6, 预期为 51.5。中国1月官方非制造业 PMI 为 55.3, 预期为 54.9, 前值为 55。
2. 发改委公布, 12 月份全国铁路完成货运量 3.04 亿吨, 同比下降 3.8%。2017 年全国铁路累计完成货运量 36.89 亿吨, 同比增长 10.7%。12 月份, 全社会完成货运量 41.59 亿吨, 同比增长 2.9%。2017 年全社会累计完成货运量 471.48 亿吨, 同比增长 9.3%。
3. 据中物联钢铁物流专业委员会 31 日发布的指数报告, 2018 年 1 月份, 国内钢铁行业 PMI 指数为 50.9%, 环比上升 0.7 个百分点, 连续 9 个月处在 50% 以上的扩张区间。
4. 发改委副主任连维良表示, 针对部分电厂存煤减少情况, 发改委、交通部、铁路总公司已经采取了相关措施。目前, 全国统调电厂平均存煤在 15 天左右的合理范围。近一个时期, 发改委和铁路总公司一起专门制定了针对部分电厂存煤低于 7 天的措施。现已排查出 26 个存煤低于 7 天的电厂, 铁路部门重点予以保障, 确保电厂存煤在安全范围内, 在这一点上有足够能力和足够措施。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1805	510	-7.5	2177776	109550
焦炭 1805	2007	-5.5	254502	242
螺纹钢 1805	3915	-6	3264302	-85224

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	0
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	575	0
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	526	0
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	526	0
钢坯: Q235: 唐山	3590	10
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	3890	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	3940	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	3980	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
I1805	510	普氏指数	折算	-61.7
		73.1	571.72	
RB1805	3915	上海螺纹钢	折算	-95.3
		3890	4010.31	

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	18620	586

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%	73.1	-0.4
MBIO:62%	72.92	-0.05

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。