

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8日星期四

后市展望及策略建议:

兴证铁矿: 铁矿石隔夜震荡盘整。昨日铁矿石现货价格持稳。受港口检修增多的影响, 澳洲巴西本周发货量环比减少; 另一方面, 北方六港到港量增加幅度较大, 从船期推算下周到港量仍将维持相对高位。目前钢厂本轮补库接近尾声, 节前需求方面难有支撑。总体来看矿石依然偏弱, 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. 工信部发文称, 力争2018年提前完成“十三五”钢铁去产能1.5亿吨的上限目标。对“地条钢”高发的重点省(区、市), 部际联席会议将于今年上半年组织开展防范“地条钢”死灰复燃专项督查。对不同地区新建电炉项目在产能置换政策上给予适当倾斜, 鼓励小型电炉企业联合重组和接收过剩地区转移产能, 发展先进水平的电炉企业。
2. 2月7日, 国家安全生产监督管理总局组织召开的钢铁企业事故警示视频会议, 定于2018年在全国深入开展钢铁企业重大生产安全事故隐患排查治理专项行动。会议要求, 各级安全监管部门要根据通知要求, 制定切实可行的本地区工作方案, 摸清底数, 按照分级属地原则确定每家钢铁企业的监管部门。各钢铁企业要制定本企业的工作方案, 做到“一企一方案”。
3. 大商所就铁矿石期货引入境外交易者相关规则修正案及草案公开征求意见, 明确了境外交易者可以直接委托期货公司会员进行交易, 或者委托境外经纪机构, 由境外经纪机构转委托期货公司会员进行交易。
4. 环保部部长李干杰日前在全国环保工作会议上表示, 今年环保部将继续推进北方地区清洁取暖工程。据央视报道, 2018年北方地区清洁能源改造工作预计将完成煤改气、煤改电400万户, 并把确保民众温暖过冬作为推进改造的前提条件。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1805	526.5	5.5	1896742	-99368
焦炭 1805	2155.5	36	317066	7480
螺纹钢 1805	3937	-6	3107562	-35684

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%	530	0
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	578	0
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	532	-2
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	532	-2
钢坯: Q235: 唐山	3610	-30
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	3900	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	3950	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	4050	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	526.5	77.5	600.18	-73.7
RB1805	3937	上海螺纹钢	折算	-83.6
		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	0
螺纹钢:吨	20379	585

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	74.65	0.25
新加坡铁矿石掉期：5月合约	73.25	0.5

数据来源：Bloomberg

铁矿石相关指数：

	最新价	变动
普氏:62%	77.5	1.5
MBIO:62%	77.2	1.28

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。