

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13日星期二

后市展望及策略建议:

兴证铁矿: 铁矿石隔夜震荡盘整为主。临近春节, 市场整体成交清淡。钢厂节前备货结束, 厂内铁矿石库存处于相对较高水平。目前矿石港口库存压力较大, 需求或将等到3月限产结束前后才有所起色。短期建议投资者暂时观望, 仅供参考。

兴证点钢: 期螺夜间小幅冲高回落, 现货市场基本放假。目前现货交易没有标的, 预计市场库存被动累积。建议投资者观望。仅供参考。

市场消息:

1. 央行公布数据显示, 中国1月M2同比增8.6%, 预期8.2%, 前值8.2%; 新增人民币贷款29000亿元, 创历史新高, 预期21142亿元, 前值5844亿元; 1月社会融资规模增量为3.06万亿元, 预期3.15万亿元, 前值1.14万亿元。
2. 发改委于近日发布了关于做好2018年电煤、钢煤中长期合同履行监管工作的通知, 确保半年及全年履约率不低于90%。
3. 上证综指触底反弹, 收涨0.78%报3154.13点; 深成指涨近3%报10291.88点; 创业板指数报复性反弹, 收涨3.5%报1648.07点。两市成交3497亿元, 量能创一个半月新低。
4. 美国白宫披露特朗普递交给国会的基建计划大纲。特朗普要求国会针对基建议案迅速采取行动, 针对未来10年至少批准1.5万亿美元新的投资计划, 将项目审批时间缩短至两年甚至更短, 解决尚未兑现的农村基建需求, 培训未来劳动力。

行情回顾：

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1805	523	-0.5	1747998	-184440
焦炭 1805	2110.5	5	255978	-31992
螺纹钢 1805	3918	23	2901588	-135298

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%	580	0
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	537	0
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	537	0
钢坯: Q235: 唐山	3610	0
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	523	76.55	594.26	-71.3
RB1805	3918	上海螺纹钢	折算	-102.6
		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	21258	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	74.85	0.2
新加坡铁矿石掉期：5月合约	73.65	0.3

数据来源：Bloomberg

铁矿石相关指数：

	最新价	变动
普氏:62%	76.55	0

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。