

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3月9日星期五

后市展望及策略建议:

兴证铁矿: 铁矿石隔夜收跌。昨日铁矿石现货价格走低, 整体成交一般; 钢厂自身库存足够, 进口矿可用天数环比上升一天, 同时随着市场转向走弱, 钢厂仍采取观望态度, 未有积极补库动作。整体来看, 铁矿石中长期基本面仍然偏弱, 短期建议投资者暂时观望, 仅供参考。

市场消息:

1. 据海关统计, 今年前2个月, 我国货物贸易进出口总值4.52万亿元人民币, 比去年同期增长16.7%。其中, 出口2.44万亿元, 增长18%; 进口2.08万亿元, 增长15.2%; 贸易顺差3622亿元, 扩大37.2%。
2. 经济参考报头版刊文称, 不平衡不充分发展的重要原因在于实体经济。今年政府工作报告明确指出, 深入推进供给侧结构性改革。坚持把发展经济着力点放在实体经济上, 继续抓好“三去一降一补”, 大力简政减税减费, 不断优化营商环境, 进一步激发市场主体活力, 提升经济发展质量。
3. 经济参考报头版刊文称, 不平衡不充分发展的重要原因在于实体经济。今年政府工作报告明确指出, 深入推进供给侧结构性改革。坚持把发展经济着力点放在实体经济上, 继续抓好“三去一降一补”, 大力简政减税减费, 不断优化营商环境, 进一步激发市场主体活力, 提升经济发展质量。
4. 3月8日上午, 全国人大代表、河北省常务副省长袁桐利表示, 今年河北省将压减钢产能和铁产能各1000万吨以上; 累计出清8家钢铁僵尸企业, 剩余的3家钢铁僵尸企业今年年内全部出清; 河北还将支持企业兼并重组, 推动城市钢厂减量搬迁, 引导钢铁产业向沿海临港地区转移, “推动环首都和生态敏感地区钢铁产能的有序退出”。

行情回顾:

合约	收盘价	涨跌	持仓量	增减
铁矿石 1805	500.5	-17	2107784	55658
焦炭 1805	2112	-39	263392	-6646
螺纹钢 1805	3794	-96	3584146	194308

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%	535	0
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	575	-3
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	528	-4
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	528	-4
钢坯: Q235: 唐山	3630	-70
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	3960	-40
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	3950	-80
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	4030	-50

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	500.5	72	562.73	-62.2
RB1805	3794	上海螺纹钢	折算	-288.5
		3960	4082.47	

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	26239	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：5月合约	69.65	-2.2
新加坡铁矿石掉期：7月合约	68.5	-2

数据来源：Bloomberg

铁矿石相关指数：

	最新价	变动
普氏:62%	72	-3.2
MBIO:62%	73.23	-2.61

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。