

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

投资咨询编号: Z0010649

从业资格编号: F3024409

021-20370977

liwj@xzfutures.com

韩惊

投资咨询编号: Z0012908

从业资格编号: F3010931

021-20370949

hanjing@xzfutures.com

2019年1月29日星期二

内容提要

● 后市展望及策略建议:

兴证点钢: 夜间期螺价格回落, 多头主动获利了结。临近春节现货放假, 期货提保。建议投资者观望为主。仅供参考。

兴证铁矿: 铁矿石期价隔夜震荡, 昨日港口现货价格上涨, 成交一般。淡水河谷大坝事故遇难人数继续增加, 虽然受灾矿区整体产量本身有限, 但需要预防可能由此带来的更大规模的检修等其它进一步的影响。目前临近春节, 钢厂库存达到相对高位, 继续补库的空间有限。我们预计短期铁矿石期价在市场情绪的影响下仍将偏强, 建议投资者暂时观望, 仅供参考。

● 市场消息:

- 1月28日, 中国银保监会新闻发言人肖远企接受记者采访时表示, 为更好发挥保险公司机构投资者作用, 维护上市公司和资本市场稳定健康发展, 银保监会鼓励保险公司使用长久期账户资金, 增持优质上市公司股票和债券, 拓宽专项产品投资范围, 加大专项产品落地力度。支持保险公司开展价值投资、长期投资, 研究推进保险公司长期持有股票的资产负债管理监管评价机制。
- 1月28日, 农历小年, 我国期货市场迎来商品期权大扩容。天然橡胶期权、棉花期权、玉米期权同时推出。这标志着我国期权市场扩容时代到来, 相关产业链进入风险管理新阶段, 也表明我国建设有国际影响力的期货与衍生品市场迈入发展快车道。从上市首日收盘情况看, 三个品种成交活跃。
- 新京报记者独家获悉, 渤海钢铁集团股权已从天津市国资委划转至天津一家名叫渤海国投的国企名下。目前, 该事项已完成工商变更。按照计划, 1月30日, 渤钢系企业债权人会议就将召开, 对《渤钢系企业重整计划(草案)》进行表决。

相关表格:

表 1：行情回顾

合约	收盘价	涨跌	总持仓量	增减
铁矿石 1905	550.5	16.5	1226496	-38712
焦炭 1905	2041	-7.5	383946	18096
螺纹钢 1905	3681	-29	3322472	-102732

数据来源：Wind，兴证期货研发部

表 2：现货价格

	最新价	变动
铁精粉:湿基不含税出厂价:唐山: 66%	565	0
车板价:天津港:澳大利亚:纽曼粉:62.5%	603	10
车板价:青岛港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	571	11
车板价:日照港:澳大利亚:PB 粉:61.5%	571	11
钢坯: Q235: 唐山	3430	30
螺纹钢: HRB400 20MM: 上海	3780	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 杭州	3800	0
螺纹钢: HRB400 20MM: 天津	3870	0

数据来源：Wind，兴证期货研发部

表 3：仓单:

品种	仓单量	变动
铁矿石:手	0	0
焦炭: 手	0	0
螺纹钢: 吨	20580	0

数据来源：Wind，兴证期货研发部

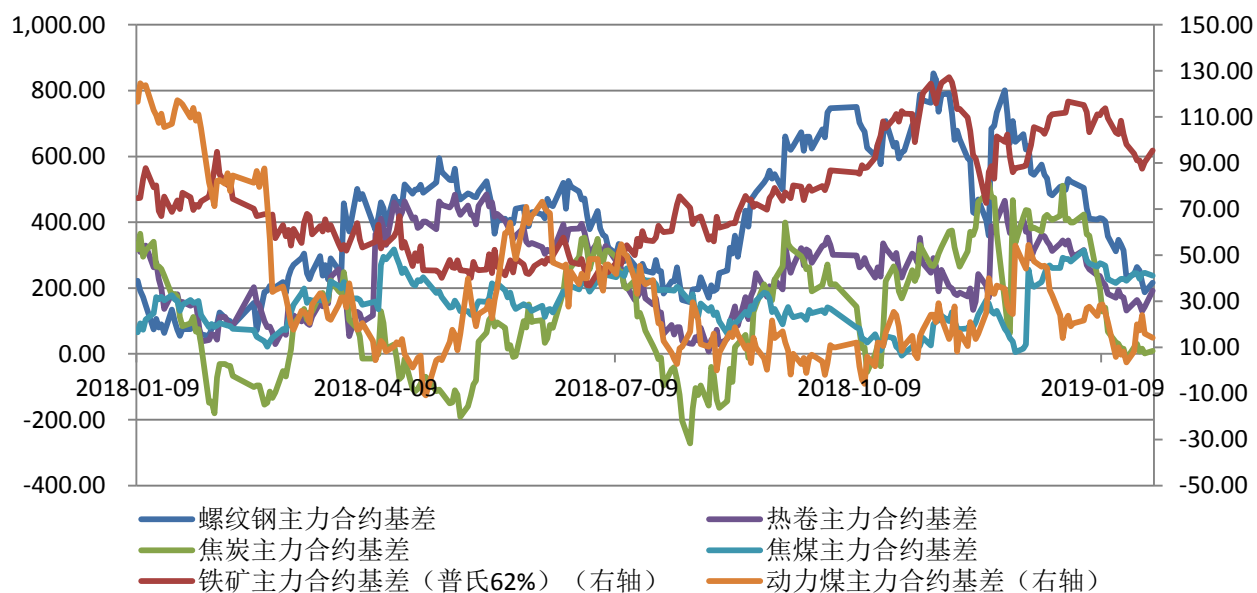
表 4：铁矿石指数:

	最新价	变动
普氏:62%	78.7	3.3
MBIO:62%	74.69	/

数据来源：Wind，兴证期货研发部

相关图表：

图 1. 黑色品种基差



	螺纹基差	热卷基差	铁矿基差	焦炭基差	焦煤基差	动力煤基差
最新价	216	192	95	9	238	14
变动	29	50	5	8	-9	-2

数据来源：Wind，兴证期货研发部

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。报告所采用的数据均来自公开资料，分析逻辑基于本人的职业理解，通过合理判断的得出结论，力求客观、公正，结论，不受任何第三方的授意影响。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

本报告的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。文中的观点、结论和建议仅供参考。兴证期货可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。本报告及该等报告反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。报告所载资料、意见及推测仅反映分析员于发出此报告日期当日的独立判断。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。

本报告的观点可能与资管团队的观点不同或对立，对于基于本报告全面或部分做出的交易、结果，不论盈利或亏损，兴证期货研究发展部不承担责任。

本报告版权仅为兴证期货有限公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处兴证期货研究发展部，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。