

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

一. 行业新闻

钢材

1 月 28 日，从国家统计局获悉，2018 年全国规模以上工业企业实现利润总额 66351.4 亿元，比上年增长 10.3%。2018 年，在 41 个工业大类行业中，32 个行业利润总额比上年增加，9 个行业减少。主要行业利润情况如下：煤炭开采和洗选业利润总额比上年增长 5.2%，石油、煤炭及其他燃料加工业增长 10.7%，黑色金属冶炼和压延加工业增长 37.8%。

1 月 28 日，唐山 28 日起启动重污染天气 II 级应急响应，据唐山人民政府网站消息，根据省环境应急与重污染天气预警中心与中国环境监测总站、省环境气象中心最新会商，市重污染天气应对指挥部决定自 2019 年 1 月 28 日 8 时至 30 日 12 时，全市启动重污染天气 II 级应急响应（如需延长应急响应，另行通知），其中，港口集疏运车辆禁行措施起止时间为 1 月 28 日 8 时至 30 日 8 时。钢铁行业：绩效评价为 A 类且厂址位于城市建成区外（包括县区）的烧结机停产 30%，位于城市建成区内（包括县区）的烧结机停产 40%；评价为 B 类的，烧结机停产 50%；评价为 C 类的，烧结机停产 60%；评价为 D 类的，烧结机全停。各企业于 1 月 27 日 18 时前将预警期间烧结机生产计划报属地政府和市环保指挥中心备案，备案后严禁擅自调整。

1 月 28 日，唐山海翼宏润钢坯库存 16.45 万吨。另外 1 月 27 日早八点到 1 月 28 日早八点，总入库量为 1.31 万吨，总出库量 0.09 万吨，较上日库存增加 1.22 万吨。

铁矿石

1 月 25 日，普氏 62%铁矿石指数报 75.40 美元/吨，较前一交易日持平。

1 月 28 日，淡水河谷确认尾矿坝泄漏 铁矿石价格短期或受扰动，据中国证券网，据巴西媒体报道，巴西淡水河谷（Vale）位于米纳斯吉拉斯州的 MinaFeijão 矿区发生矿坝决堤事故。受事故影响，在美上市的淡水河谷股价收跌 8.08%，报 13.66 美元/股，盘中一度跌至 12.85 美元/股，创 1 月 3 日以来盘中最低。淡水河谷方面最新确认，1 月 25 日下午，米纳斯吉拉斯 Brumadinho 地区 Feijão 矿区 1 号尾矿坝发生泄漏。公司正在全力以赴为受到影响的人们提供救援。泄漏的尾矿流至员工工作所在的行政区，遇难情况仍无法确认。

中融汇信期货

徐懌臻

期货从业资格号：F3041728

投资咨询资格号：Z0013801

微信公众号：



联系方式：021-51557562

邮箱：xulili@zrhxqh.com

网址：http://zrhxqh.com/

地址：上海市浦东新区源深路

1088 号平安财富大厦 25 楼



钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

1/28, 螺纹开盘 3712, 盘中最低 3680, 尾盘报收 3681; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3780 元/吨; 天津: 3870 元/吨, 相比上交易日持平, 基差 99, 偏低, 期货下跌致期货贴水扩大, 唐山钢坯 3430 元/吨, 与昨日持平, 盘面利润(理论) 580.48; 据国家统计局 2018 年全国规模以上工业企业实现利润总额 66351.4 亿元, 其中黑色金属冶炼和压延加工业增长 37.8%; 唐山 28 日重启重污染天气预警, 钢厂烧结机分级错峰限/停产按 30%、40%、50%、60%不等, 螺纹实际周产量小幅下降; 节前冬储放缓, 厂/社库分化; 产量小幅减少, 冬储进行中, 厂库去化, 现货维持, 盘面震荡上行; 铁矿石上涨至 550.5, 现货 pb 粉(湿基): 577 (+12); 淡水河谷确认尾矿坝泄漏, 米纳斯吉拉斯 Brumadinho 地区 Feijão 矿区 1 号尾矿坝发生泄漏, 需要进一步关注事情的进展, 短期内对铁矿供应预期减少; 节前钢厂补库基本结束, 但淡水河谷尾矿坝泄漏, 短期内对盘面影响极大叠加节假日影响, 观望为主。操作建议: 目前利润回升至 600 附近, 螺纹盘面震荡上行, 短线区间操作, 或择机逢低正套 05-10 (215), 注意控制风险。铁矿石淡水河谷尾矿坝泄漏叠加节假日影响, 观望为主。

三. 基本面数据

品种	区域	现货价格	涨跌	收盘	涨跌	基差
螺纹	上海	3780	0			
	天津	3870	0			
	螺纹05-10	215		3681	-29	99
	盘面利润	580.48				
	现货模拟利润	679.48				
热卷	上海	3930	-40			
	天津	3900	-50	3588	-20	342
	热卷05-10	173				
钢坯	唐山	3430	0			
铁矿pb (湿基)	华北 (曹妃甸)	577	12	550.5	16.5	26.5
	铁矿05-09	28				
二级焦炭	唐山	1965	0	2041	-7.5	-76

免责声明

本报告所载的内容仅作参考之用, 不作为或被视为出售或购买期货品种的要约或发出的要约邀请。此报告的内容不构成对任何人的投资建议, 而中融汇信不会因接收人收到此报告而视他们为其客户。本报告中的信息均来源于公开可获得资料, 中融汇信力求准确可靠, 但对信息的准确性及完整性不做任何保证。客户应谨慎考虑本报告中的任何意见和建议, 不能依赖此报告以取代自己的独立判断, 而中融汇信不对因使用此报告而引起的损失负任何责任。本报告仅反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。本报告所载的观点不代表中融汇信期货有限公司的立场。中融汇信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。未经中融汇信授权许可, 任何引用、转载以及向第三方传播的行为均可能承担法律责任。