

钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

一. 行业新闻

钢材

6月17日，唐山市进一步强化6月份下半月大气污染防治管控措施，6月16日至30日期间，在严格执行《6月份大气污染防治强化管控措施实施方案》的基础上，进一步提级限产减排措施，现将有关要求。其中开平区唐钢北厂区、唐银钢铁公司保留一台烧结机生产，其余烧结机停产。丰润区、古冶区、丰南区、滦南县、滦州市、迁安市钢铁企业烧结机、球团、石灰窑停产比例不低于50%。

6月17日，武安市重污染天气应急指挥部根据邯郸市重污染天气应急指挥部办公室《关于强化大气污染防治应急管控措施的通知》要求，预计未来一周(15—21日)，邯郸地区地面温度较高，扩散条件一般，空气质量以轻—中度污染为主，部分时段出现重度污染。为保障我市空气质量，经市政府研究决定。自2019年6月16日8时—6月22日20时严格执行以下强化管控措施。具体措施有，钢铁、焦化、水泥等行业必须严格执行二季度差别化管控，其中，钢铁行业，凡不能实现超低排放改造稳定达标排放的烧结机，强化管控期间，实施停产；焦化行业焦炉结焦时间全部延长至36小时，且出焦尽量避开午间时段，化产区域的装卸料时间调整到夜间。

6月13日，据中国工程机械工业协会统计，2019年5月纳入统计的25家挖掘机制造企业共销售各类挖掘机18897台，同比下降2.15%。国内市场销量16744台，同比下降5.88%。出口2153台，同比增长41.4%。1-5月累计总销量122086台，同比增长15.2%；累计内销112343台，同比增长13.8%；累计出口9640台，同比增长34.4%。

铁矿石

6月14日，普氏62%铁矿石指数报109.40美元/吨，较前一交易日下跌0.80美元/吨，跌幅0.73%，止步四连涨。

6月17日，在新西兰克马德克群岛(南纬30.80度，西经178.10度)发生7.2级地震，震源深度20千米。据欧洲地中海地震中心消息，新西兰克马德克群岛发生地震，太平洋海啸预警中心(PTWC)发布海啸预警。新西兰民防组织表示，若发生海啸，预计在两小时后到达新西兰。澳大利亚气象局消息称，澳大利亚没有海啸威胁。据推测，即使有海啸威胁，但因澳大利亚主要铁矿石港口大多在澳大利亚正对新西兰的另一侧，港口所受影响也微乎其微。值得注意的是，海啸发生具有一次性的特点，即一旦发生，很快就过去。综合来看，预计澳大利亚铁矿石港口运输暂不受影响。



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：021-51557597

邮箱：xulili@zrhxqh.com

网址：<http://zrhxqh.com/>

地址：中国（上海）自由贸易试验区

东育路255弄5号29层



钢矿日报 Steel & ironstone Daily Report

二. 行情分析

6/17, 螺纹开盘 3750, 盘中最低 3700, 尾盘报收 3704; 目前螺纹现货上海 hrb400, 20mm: 3870 元/吨; 天津: 3790 元/吨, 相比上交易日-50/-60, 基差 166, 期货下跌致期货贴水轻微扩大, 唐山钢坯 3510 元/吨, 与昨日+10, 盘面利润(理论) 40.06; 长流程利润快速下降, 电弧炉(成本偏高地区)模拟利润转为亏损, 高炉开工率小幅下降, 周产量 381.19 万吨, 较上周减少 0.33 万吨, 产量处高位。消费进入季节性淡季, 但韧性犹存, 且受专项债等消息影响需求预期有所增加, 厂/社库双增。现货小幅下跌, 成交转淡, 成本 3650 附近有支撑, 盘面震荡为主。

铁矿石延续前期的逻辑观点长短流程基本接近, 废钢生产替代效应显现, 但电弧炉开工一直处于高位, 钢厂调整空间有限, 对铁矿边际需求影响偏小, 铁矿整体维持强势, 后续如无重大政策及供应事件影响, 上方空间或有限。目前, 受淡水河谷尾矿或关停、专项债、力拓长协等消息影响, 价格临近 800 附近风险加剧, 仓单方面河钢国际(唐山港)注册仓单 1100 手, 谨慎操作为主。

操作建议: 目前利润 50 附近, 螺纹盘面震荡, 短线区间操作, 注意控制风险。铁矿石震荡上行, 短线区间操作, 注意控制风险。

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	3870	-50			
	天津	3790	-60			
螺纹10-01		260		3704	-51	166
盘面利润		40.06				
现货模拟利润		206.06				
热卷	上海	3990	-40	3585	-	405
	天津	3920	-50			
钢坯	唐山	3510	10			
铁矿pb(湿基)华北(曹妃甸)		812	9	768.5	-15	43.5
	铁矿05-09	84.5				
二级焦炭	唐山	2150	0	-	-	-

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。