

“东海智慧眼”一周提示（螺纹钢 1810）

东海期货 | 智慧眼

研究所 黑色金属策略组

智慧眼提示

刘慧峰 首席研究员

从业资格证号：F3033924

投资分析证号：Z0013026

联系电话：021-68757223

邮箱：

“东海智慧眼”是东海期货研究所研发的融合定量分析与定性分析构建的一个价格分析预测系统，依托科学专业的动量技术模型，通过对市场数据与技术指标的高精度测评、反复多次的历史回测、模拟验证、统计检验，实时跟踪市场趋势，及时提示市场拐点。

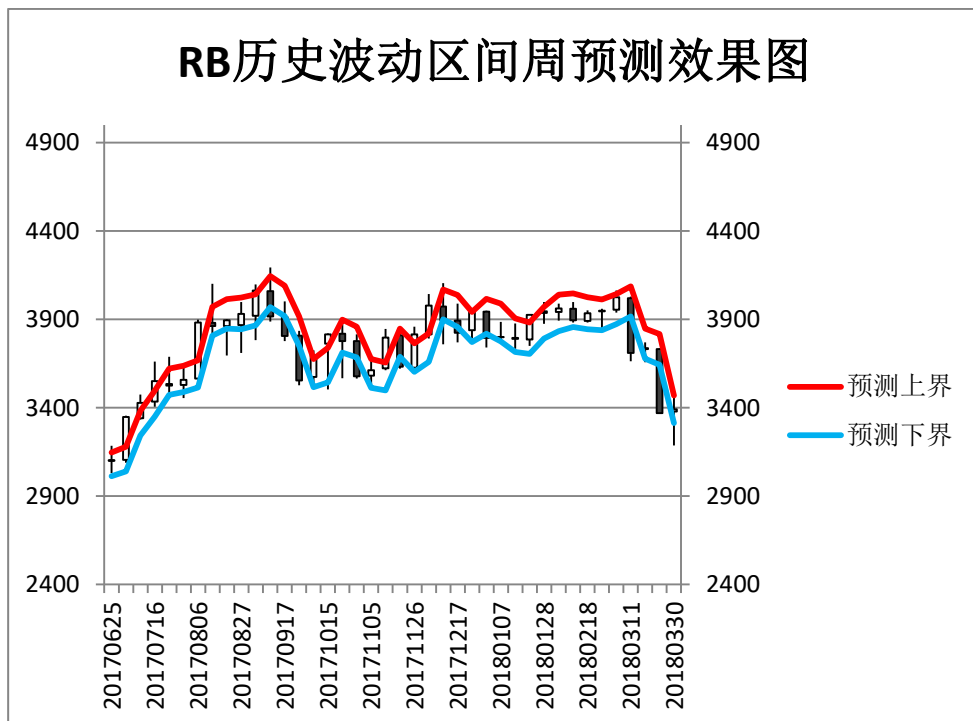
动量技术模型信号提示

趋势预测 短线：高位盘整

中线：震荡上行

区间预测（基于电脑模型） 集中波动区间：3265-3432

RB 历史波动区间周预测效果图



一、基本面重点关注信息提示

1、3月份国内钢铁行业PMI指数为50.6%，环比回升1.1个百分点，重新回到50%的荣枯线上方。在主要的分项指数中，钢铁生产指数显著回升至扩张区间，新订单指数小幅上升，新出口订单指数进一步降低，产成品库存指数明显上升，原材料库存指数降至收缩区间。这些指数信息综合显示，3月份国内钢厂生产加快，订单回升缓慢，受到钢厂和社会库存增加以及美国政策影响，钢材价格下跌。不过，从3月下旬的市场表现来看，市场需求正在加快释放，高库存压力逐步消化。

2、2018年5月至6月，钢铁煤炭行业化解过剩产能和脱困发展工作部际联席会议将牵头组织开展防范“地条钢”死灰复燃和已化解的过剩产能复产专项大检查。防范“地条钢”死灰复燃和已化解的过剩产能复产，这是今后一个时期去产能工作的重点任务之一。此次专项大检查主要针对“地条钢”易发高发的重点省(区、市)，部际联席会议将根据举报信息，及时组织开展抽查和专项核查。

3、去年河北省钢铁行业实现利润714.37亿元，同比增长151.22%，占全省工业利润的22.91%，数据显示，去年河北省钢铁行业去杠杆工作成效明显，全行业资产负债率有所下降，利润率提高，开始走上质量效益发展轨道。

二、结论

综合“东海智慧眼”系统信号及基本面信息，在今年资金面整体偏紧，房地产、基建投资大概率下行的背景下，黑色系中线下行趋势不改。但短期来看，在宏观预期阶段性修复、季节性需求旺季到来、库存下滑明显等多重因素影响，钢材市场有望走出阶段性反弹行情。

操作上重点关注： 阻力：3432, 强阻力：3600
支撑：3265, 强支撑：3000

免责条款：

“东海智慧眼一周提示”立足于结合基本面及技术面对市场价格运行趋势及轮廓进行整体判断，提示可能存在的投资风险与投资机会。报告中的信息均源自于公开材料，我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证，报告中的价格区间预测来自于电脑模型，仅供参考。本报告在任何情况下均不构成对所述期货品种的买卖建议，我们也不承担因根据本报告操作而导致的损失。

联系方式：

公司地址：上海浦东新区东方路1928号东海证券大厦8层

邮政编码：200125

公司网址：www.qh168.com.cn