

撰写人: 蔡跃辉 从业资格证号: F0251444 投资咨询从业证书号: Z0013101

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	I主力合约收盘价(元/吨)	849.50	+15.50↑	I主力合约持仓量(手)	787,366	+23168↑
	I9-1合约价差(元/吨)	75	-1.50↓	I合约前20名净持仓(手)	46661	+3649↑
	I大商所仓单(手)	3,200.00	-1300.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	115	+2.65↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	938	+2↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	919	-2↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	798	+2↑	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	70	-18↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	114.00	-1.85↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.40	+0.01↑
	进口成本预估值(元/吨)	951	-15↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,449.30	+16.90↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,534.60	+20.00↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,495.17	-143.39↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,522.33	-108.04↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,552.00	-65.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	67.84	+2.19↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	110.40	-8.98↓
	BDI指数	1,004.00	-33.00↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.495	-0.14↓
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.31	-0.22↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.495	-0.14↓
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.33	-0.15↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.20	-0.91↓
国内粗钢产量(月, 万吨)	9,111	+99↑				
	标的历史20日波动率(日, %)	24.69	+0.63↑	标的历史40日波动率(日, %)	28.74	-0.09↓
期权市场	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	24.62	-0.19↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	24.26	-0.16↓
	行业消息	<p>1、20日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2261.62万吨, 环比上期降119.64万吨。烧结粉总日耗111.82万吨, 增0.07万吨。库存消费比20.23, 降1.08。</p> <p>2、《中共中央 国务院关于促进民营经济发展壮大的意见》重磅发布, 对民营经济定位作出重要表述, 首次提出“生力军”。</p>				
观点总结	<p>周四I2309合约震荡走高, 进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均小幅增加, 将提升现货供应。贸易商报价积极性尚可, 报价随行就市为主; 钢厂方面, 部分钢厂刚需补库, 由于钢厂维持小幅盈利, 主动减产意愿不强, 铁水产量维持高位震荡。另外, 国家发改委表示, 将抓紧制定出台恢复和扩大消费的政策, 对矿价也存在一定支撑。技术上, I2309合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上反弹。操作上建议, 偏多交易, 注意风险控制。</p>					
重点关注	周五铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率					

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!

备注: I: 铁矿石

