

撰写人: 许方莉 从业资格证号: F3073708 投资咨询从业证书号: Z0017638

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	主力合约收盘价(元/吨)	724.00	+10.00↑	主力合约持仓量(手)	791,628	+9000↑
	9-1合约价差(元/吨)	48.5	+5.50↑	合约前20名净持仓(手)	-19177	-3625↓
	大商所仓单(手)	1,800.00	+200.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	103.25	+1.24↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	851	+3↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	843	+4↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	714	+12↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	119	-6↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	106.00	-3.95↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.48	-0.02↓
	进口成本预估值(元/吨)	860	-30↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,615.40	+36.50↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,149.50	+271.50↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,736.28	-150.71↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,840.76	-452.53↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,044.20	-978.80↓	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	-3.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	62.04	-0.06↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	143.98	+3.51↑
下游情况	BDI指数	1,598.00	+40.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	9.435	+0.53↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.44	+0.13↑			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	81.69	-0.87↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.49	-1.14↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,573	+1784↑			
行业消息	标的历史20日波动率(日, %)	29.43	+1.00↑	标的历史40日波动率(日, %)	36.80	+0.24↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.70	-0.03↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	31.07	+0.96↑
观点总结	1、5月1日-5月7日中国47港到港总量2149.5万吨, 环比增加271.5万吨; 中国45港到港总量2067.3万吨, 环比增加258.5万吨; 北方六港到港总量为970.9万吨, 环比增加181.5万吨。 2、4月中国进口铁矿砂及其精矿9044.2万吨, 较上月减少978.7万吨, 环比下降9.8%; 1-4月累计进口铁矿砂及其精矿38468.4万吨, 同比增长8.6%。					
	周三I2309合约震荡偏强, 进口铁矿石现货报价小幅上调。贸易商报盘积极性较高, 以适价出货为主, 钢厂多谨慎询盘, 以低点补库为主。本期铁矿石港口库存继续下滑, 且低于去年同期1500万吨, 但钢厂高炉开工率及产能利用继续下调将减少铁矿石现货需求。技术上, I2309合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴附近。操作上建议, 日内短线交易, 注意风险控制。					
重点关注						

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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!