

撰写人: 陈一兰 从业资格证号: F3010136 投资咨询从业证书号: Z0012698

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)	686.50	-16.00↓	主力合约持仓量(手)	767,572	+27511↑
	1-5合约价差(元/吨)	36	-2.00↓	合约前20名净持仓(手)	-35421	-9882↓
	大商所仓单(手)	3,000.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	91.6	-2.17↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	788	-11↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	774	-10↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	703	-14↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	87	+6↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	96.15	+1.95↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.13	+0.05↑
	进口成本预估值(元/吨)	807	+16↑			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,471.90	+19.80↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,252.10	-456.30↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,992.70	+30.85↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,396.87	+68.44↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,621.00	+497.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	21.00	+2.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	57.81	-4.75↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	250.00	-0.39↓
下游情况	BDI指数	1,838.00	+20.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	9.042	+0.02↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	23.32	+0.06↑			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.62	-0.88↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.04	+0.06↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,387	+244↑			
行业消息	标的历史20日波动率(日, %)	24.00	+0.01↑	标的历史40日波动率(日, %)	34.40	+0.28↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	32.33	+5.02↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	32.32	+3.08↑
观点总结	1、10月10日-10月16日中国47港到港总量2252.1万吨, 环比减少456.3万吨; 中国45港到港总量2112.5万吨, 环比减少541.2万吨; 北方六港到港总量为964.0万吨, 环比减少301.6万吨。 2、10月10日-10月16日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2471.9万吨, 环比增加19.8万吨。澳洲发运量1792.7万吨, 环比增加12.2万吨, 其中澳洲发往中国的量1591.1万吨, 环比增加207.7万吨。巴西发运量679.2万吨, 环比增加7.6万吨。					 更多资讯请关注!
	周一I2301合约增仓下行, 进口铁矿石现货报价下调。贸易商报价积极性一般, 部分贸易商降价出货; 而钢厂按需采购, 周初部分钢厂有补库计划。当前, 由于钢厂利润微薄, 生产积极性欠佳, 采购需求偏低, 造成买方低价采购意愿高, 但本期铁矿石到港量大幅减少或限制矿价下行空间。技术上, I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议, 震荡偏空交易, 注意风险控制。					 更多观点请咨询!
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