



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	I 主力合约收盘价 (元/吨)	698.50	-25.50↓	I 主力合约持仓量(手)	785,172	-6456↓
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	43.5	-5.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	-22113	-2936↓
	I 大商所仓单 (手)	2,300.00	+500.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	98.9	-4.40↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	830	-21↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	817	-26↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	691	-22↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	119	-0↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	107.50	+1.50↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.56	+0.08↑
	进口成本预估值(元/吨)	869	+9↑			
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	0.00
	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↑
	BDI指数	1,640.00	+42.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.56	+0.11↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.435	0.00
下游情况	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↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	30.44	+1.01↑	标的历史40日波动率(日, %)	37.55	+0.75↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	31.69	+0.99↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	31.91	+0.84↑
行业消息	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、11日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2441.6万吨，环比上期降1.68万吨。					 更多资讯请关注！
观点总结	周四I2309合约减仓下行，进口铁矿石现货报价下调。钢价走弱打压市场信心，贸易商报盘积极性尚可，以适价出货为主，钢厂多谨慎询盘，以低点补库为主。随着钢厂高炉开工率及产能利用继续下调将进一步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	周五国内铁矿石港口库存、厂内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