# 瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

# 铁矿石产业链日报

2023/6/1

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） | 743.00 | +32.00↑ | I 主力合约持仓量(手) | 801,640 | +33498↑ |
| | I 9-1合约价差（元/吨） | 59.5 | +3.50↑ | I 合约前20名净持仓(手) | -11290 | +14206↑ |
| | I 大商所仓单（手） | 2,000.00 | -200.00↓ | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨) | 102.25 | +3.85↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨) | 835 | +21↑ | 青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨) | 819 | +20↑ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨) | 704 | +20↑ | I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约) | 76 | -12↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数（美元/吨） | 103.20 | +0.55↑ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.54 | -0.12↓ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 858 | +6↑ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周，万吨) | 2,477.50 | -24.50↓ | 中国45港到港总量(周，万吨) | 2,408.90 | +117.00↑ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周，万吨) | 12,793.83 | +7.62↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周，万吨) | 8,635.33 | -58.04↓ |
| | 铁矿石进口量(月，万吨) | 9,044.00 | -979.00↓ | 铁矿石可用天数(周，天) | 16.00 | 0.00 |
| | 全国126座矿山开工率(旬，%) | 62.11 | +0.07↑ | 全国126座矿山库存量(旬，万吨) | 145.06 | +1.08↑ |
| | BDI指数 | 977.00 | -146.00↓ | | | |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 18.57 | -0.75↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 7.415 | -0.59↓ |
| 下游情况 | 247家钢厂高炉开工率(周，%) | 82.36 | 0.00 | 247家钢厂高炉产能用率(周，%) | 89.93 | +0.81↑ |
| | 国内粗钢产量(月，万吨) | 9,264 | -309↓ | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日，%) | 39.10 | +2.19↑ | 标的历史40日波动率(日，%) | 42.28 | +1.86↑ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日，%) | 31.23 | -2.29↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日，%) | 31.96 | -0.62↓ |

**行业消息**

1、5月22日-5月28日Mysteel澳洲巴西19港 铁矿发运总量2477.5万吨，环比减少24.5万吨。澳洲发运量1694.9万吨，环比减少143.2万吨，其中澳洲发往中国的量1356.1万吨，环比减少212.4万吨。巴西发运量782.6万吨，环比增加118.7万吨。

2、5月财新中国制造业采购经理指数（PMI）录得50.9，较4月回升1.4个百分点，时隔两个月重回扩张区间。

更多资讯请关注！

**观点总结**

周四I2309合约增仓上行，进口铁矿石现货报价上调。钢厂高炉开工率及产能利用率预期上调，将增加铁矿石现货需求，期价走高提振市场信心，贸易商挺价情绪较高，但钢厂询盘较少，市场交投情绪一般。连日来，上海、四川、江西、湖南、广东、广西、北京等地发布高温预警，钢材终端需求仍将受到较大考验。技术上，I2309合约1小时MACD 指标显示DIFF与DEA向上走高。操作上建议，震荡偏多交易，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 、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