



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)	777.50	-6.50↓	I 主力合约持仓量(手)	746,259	+148741
	I 5-9合约价差 (元/吨)	126	+9.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	39520	-736↓
	I 大商所仓单 (手)	1,600.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	117.5	-0.22↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	957	+11↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	946	+12↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	811	+5↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	168	+18↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	120.45	+0.45↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.35	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	965	+2↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	1,752.80	-599.30↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,209.20	-112.10↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,911.51	-241.47↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,162.75	-20.40↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,023.00	+964.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	18.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	59.64	+1.70↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	157.80	-12.10↓
	BDI指数	1,368.00	-44.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	21.57	-0.34↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.715	-0.37↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.74	+0.44↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.80	+0.60↑
	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, %)	43.52	+0.01↑	标的历史40日波动率(日, %)	35.35	-0.86↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	25.23	-0.89↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	26.52	-0.55↓
行业消息	1、4月10日-4月16日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量1752.8万吨，环比减少599.3万吨。澳洲发运量1122.3万吨，环比减少709.2万吨，其中澳洲发往中国的量971.0万吨，环比减少554.5万吨。巴西发运量630.6万吨，环比增加109.9万吨。 2、发改委今日在新闻发布会上表示，针对铁矿石价格明显上涨的情况，今年以来，我们会同有关部门持续加大对铁矿石现货期货联动监管力度，多次开展约谈提醒，引导企业全面客观看待市场供需形势，严厉打击捏造散布涨价信息、囤积居奇、哄抬价格、过度投机炒作等违法违规行为，坚决维护市场秩序。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周三I2309合约增仓回调。发改委新闻发布会上表示，将继续紧盯铁矿石市场动态，会同有关部门综合采取供给保障、需求调节、市场监管等措施，坚决遏制铁矿石价格的不合理上涨，市场情绪受挫，期价再度承压走弱。另外有消息称由于近期国内钢厂效益下滑，部分企业出现主动停产检修的现象，或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，反弹抛空，止损参考800。					 <div>更多观点请咨询！</div>
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