


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	I 主力合约收盘价 (元/吨)	732.00	-0.50↓	I 主力合约持仓量(手)	687,951	-15425↓
	I 1-5合约价差 (元/吨)	30	+0.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	16850	-3082↓
	I 大商所仓单 (手)	1,900.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	95.7	+0.35↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	801	+24↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	784	+26↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	658	+5↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	52	+27↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	95.20	+1.00↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.75	-0.13↓
	进口成本预估值(元/吨)	801	+7↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,667.30	+308.60↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,431.90	+220.70↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,319.04	+60.27↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,067.08	-247.73↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,498.00	-473.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	19.00	-1.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	57.59	+4.93↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	234.78	-8.44↓
	BDI指数	1,184.00	+35.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	17.44	+0.19↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.69	+0.12↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	76.35	-0.86↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	83.36	-0.73↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,976	-719↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	35.31	-2.14↓	标的历史40日波动率(日, %)	31.97	-0.39↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	36.28	-4.62↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	37.66	-1.38↓
行业消息	1、国务院常务会议提出，加大金融支持实体经济力度，适时适度运用降准等货币政策工具，保持流动性合理充裕。 2、央行、银保监会正式发布《关于做好当前金融支持房地产市场平稳健康发展工作的通知》，就房地产融资、“保交楼”金融服务、受困房地产企业风险处置等方面做出安排，提出16条措施。					 更多资讯请关注！
观点总结	周四I2301合约区间整理，进口铁矿石现货报价上调。现货市场贸易商挺价情绪渐浓，但钢厂询货谨慎，以按需采购为主，多存压价心态。目前钢厂利润水平虽有所修复，但仍处于亏损边缘，加之自身库存尚可维持正常生产，对市场需求较小。而国务院常务会议提出，加大金融支持实体经济力度，适时适度运用降准等货币政策工具，保持流动性合理充裕。短线行情或有反复，注意操作节奏。技术上，I2301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，短线于720-750区间低买高抛，止损10元/吨。					 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