



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)	711.00	-10.50↓	I 主力合约持仓量(手)	783,961	+5140↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	106	+3.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	683	-13376↓
	I 大商所仓单 (手)	1,300.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	102.45	-1.46↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	859	-6↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	846	-7↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	724	-15↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	135	+3↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	106.80	-5.35↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.52	+0.03↑
	进口成本预估值(元/吨)	861	-41↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,397.60	+644.80↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,351.50	+142.30↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,034.54	+123.03↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,123.65	-39.10↓
	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, %)	62.10	+2.46↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	140.47	-17.33↓
	BDI指数	1,517.00	+13.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	0.00	-21.70↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	0	-8.68↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.59	-0.15↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.50	-0.30↓
	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, %)	44.22	-0.43↓	标的历史40日波动率(日, %)	36.42	-0.32↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	29.68	+2.81↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	28.88	-1.16↓
行业消息	1、4月17日-4月23日中国47港到港总量2351.5万吨，环比增加142.3万吨；中国45港到港总量2206.5万吨，环比增加44.9万吨；北方六港到港总量为984.9万吨，环比减少38.6万吨。 2、4月17日-4月23日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2397.6万吨，环比增加644.8万吨。澳洲发运量1807.4万吨，环比增加685.2万吨，其中澳洲发往中国的量1586.1万吨，环比增加615.1万吨。巴西发运量590.2万吨，环比减少40.4万吨。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周二I2309合约弱势运行，进口铁矿石现货报价继续下调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量明显增加，将提升铁矿石现货供应。而钢厂利润收缩将继续挤压铁矿石价格，叠加钢厂高炉减限产增多将减少铁矿石现货需求，整体上维持弱势。技术上，I2309合约1小时MACD 指标显示DIFF与DEA低位运行。操作上建议，偏空交易，注意风险控制。					 <div>更多观点请咨询！</div>
重点关注						