



撰写人：陈一兰 从业资格证件号：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)	721.00	-18.50↓	I 主力合约持仓量(手)	746,690	-13502↓
	I 1-5合约价差 (元/吨)	40.5	-2.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	-21156	-9672↓
	I 大商所仓单 (手)	1,500.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	94.5	-2.45↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	826	-9↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	815	-7↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	734	-11↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	94	+12↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	98.75	+2.95↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.07	+0.06↑
	进口成本预估值(元/吨)	828	+25↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,452.10	-161.90↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,708.40	+266.90↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,075.64	-108.56↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,328.43	-859.46↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,621.00	+497.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	19.00	-6.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	62.56	-1.83↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	250.39	-31.26↓
	BDI指数	1,944.00	-17.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.55	-0.12↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.01	-0.05↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.81	0.00	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.14	+0.06↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,387	+244↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	26.07	-0.44↓	标的历史40日波动率(日, %)	34.36	+0.37↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	35.08	-3.18↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	35.71	-2.52↓
行业消息	1、10月3日-10月9日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2452.1万吨，环比减少161.9万吨。澳洲发运量1780.5万吨，环比减少121.2万吨，其中澳洲发往中国的量1383.5万吨，环比减少225.2万吨。巴西发运量671.6万吨，环比减少40.7万吨。 2、10月3日-10月9日中国47港到港总量2708.4万吨，环比增加266.9万吨；中国45港到港总量2653.7万吨，环比增加311.7万吨；北方六港到港总量为1265.6万吨，环比增加220.6万吨。					 更多资讯请关注！
观点总结	周二I2301合约减仓下行，进口铁矿石现货报价下调。贸易商报价积极性尚可，但市场交投氛围一般；部分钢厂有采货计划，刚需补库为主。目前，港口铁矿石资源较为充裕，同时华北地区部分钢厂限产，而钢价走弱将挤压矿价。技术上，I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议，短线于705-735区间低买高抛，止损10元/吨。					 更多观点请咨询！
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