



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)	682.50	-24.50↓	I 主力合约持仓量(手)	777,174	+32891↑
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	47	-5.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	-30500	-3310↓
	I 大商所仓单 (手)	2,100.00	-200.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	95.5	-4.48↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	812	-15↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	797	-19↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	691	-14↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	114	+51↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	102.40	-2.45↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.65	+0.09↑
	进口成本预估值(元/吨)	846	-17↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,502.00	+174.20↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,291.90	-279.60↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,786.21	+186.15↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,693.37	-21.77↓
	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	1,348.00	-17.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.61	-0.04↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.85	+0.10↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.36	+1.26↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.12	+0.09↑
	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, %)	33.29	-0.86↓	标的历史40日波动率(日, %)	39.45	+0.68↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	34.79	+2.71↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	33.49	+1.46↑
行业消息	1、5月15日-5月21日中国47港到港总量2291.9万吨，环比减少279.6万吨；中国45港到港总量2170万吨，环比减少232.8万吨；北方六港到港总量为1121.9万吨，环比增加38.0万吨。 2、5月15日-5月21日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2502.0万吨，环比增加174.2万吨。澳洲发运量1838.2万吨，环比增加131.3万吨，其中澳洲发往中国的量1568.5万吨，环比增加124.8万吨。巴西发运量663.9万吨，环比增加42.9万吨。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周三I2309合约震荡下行，进口铁矿石现货报价下调。本期铁矿石到港量下滑，但澳巴铁矿石发运量增加，后市现货供应将逐步回升。贸易商报价积极性一般，钢厂多持观望，整体交投情绪偏冷清。当前钢企厂库低库存运转，高炉开工率小幅回升，市场对原料补库预期仍存，但由于目前终端下游需求疲软，中长期来看铁矿需求依旧堪忧。技术上，I2309合约1小时MACD 指标显示DIFF与DEA向下运行。操作上建议，维持偏空交易，注意风险控制。					 <div>更多观点请咨询！</div>
重点关注						