

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)	883.00	-32.00↓	I 主力合约持仓量(手)	722,550	-57830↓
	I 5-9合约价差(元/吨)	67	-0.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	101791	-8808↓
	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)	125	-5.79↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	973	+11↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	962	-1↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	853	0.00	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	79	+31↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	132.00	+1.55↑	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)	1,060	+7↑			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,405.50	-23.30↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,508.30	+282.80↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,682.88	-87.15↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,203.34	-54.39↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,059.00	-1301.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	17.00	-2.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	56.89	-0.50↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	181.15	-9.54↓
下游情况	BDI指数	1,535.00	-25.00↓	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	8.755	+0.13↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.59	-0.11↓			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.29	+0.29↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	88.44	+0.41↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,789	+335↑			
行业消息	标的历史20日波动率(日, %)	27.57	+3.23↑	标的历史40日波动率(日, %)	24.73	-2.45↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	35.92	+3.72↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	33.01	+2.04↑
	1、3月13日-3月19日中国47港到港总量2508.3万吨, 环比增加282.8万吨; 中国45港到港总量2333.8万吨, 环比增加200.1万吨; 北方六港到港总量为1126.8万吨, 环比增加79.7万吨。 2、国家发展改革委价格司会同有关方面赴青岛港、唐山港开展调研。国家发展改革委高度关注铁矿石市场变化, 针对一段时间以来铁矿石价格大幅上涨的情况, 将会同有关部门积极研究采取供给保障、需求调节、市场监管等措施, 遏制铁矿石价格不合理上涨, 促进铁矿石市场平稳运行。					
观点总结	周一I2305合约减仓下挫, 进口铁矿石现货报价下调。本期铁矿石港口库存继续下滑, 且低于去年同期1814.42万吨。需求端, 钢厂高炉开工率及产能利用率继续提升, 日均铁水产量延续上行。但随着海外不确定性因素增多及国家发改委开展实地调研, 深入研究铁矿石保供稳价工作, 对铁矿石市场情绪造成冲击。技术上, I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA继续向下调整。操作上建议, 震荡偏空交易, 注意风险控制。					
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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!