



撰写人：蔡跃辉 从业资格证号：F0251444 投资咨询从业证书号：Z0013101

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)	848.50	-17.50↓	I 主力合约持仓量(手)	675,256	-64538↓
	I 9-1合约价差 (元/吨)	89.5	+1.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	43817	-18760↓
	I 大商所仓单 (手)	2,400.00	+900.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	111.1	-3.83↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	957	0.00	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	936	0.00
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	816	+4↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	88	+18↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	116.45	-0.30↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.38	+0.02↑
	进口成本预估值(元/吨)	968	-3↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,442.30	-7.00↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,480.70	-53.90↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,540.56	+45.39↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,402.41	-119.92↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,552.00	-65.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	15.00	-1.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	67.84	+2.19↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	110.40	-8.98↓
	BDI指数	1,067.00	+105.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.38	+0.28↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.66	+0.12↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.60	-0.73↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.16	-0.04↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,111	+99↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	22.32	+0.14↑	标的历史40日波动率(日, %)	25.52	-0.04↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	24.69	+1.46↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	24.90	+0.91↑
行业消息	1、27日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2282.12万吨，环比上期增20.5万吨。烧结粉总日耗110.83万吨，降0.99万吨。库存消费比20.59，增0.37。 2、国家金融监督管理总局表示，下一步将抓好前期出台的各项政策落实，加大对扩大内需的金融支持力度，强化重点领域和薄弱环节的金融支持，全力推动经济持续回升向好。					 更多资讯请关注！
观点总结	周四I2309合约减仓回调，进口铁矿石现货报价平稳。贸易商报盘积极性不佳，报价随行就市；钢厂方面询盘较少，按需采购为主。由于环保限产持续导致矿石整体需求不佳，叠加粗钢平控的预期，但钢价维持反弹趋势亦将限制炉料回调空间。技术上，I2309合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴上方。操作上建议，830附近短多，止损参考820。					 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！