

撰写人: 陈一兰 从业资格证号: 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)	692.00	+24.50↑	I 主力合约持仓量(手)	717,978	-17850↓
	I 1-5合约价差 (元/吨)	33.5	0.00	I 合约前20名净持仓(手)	-7798	+22367↑
	I 大商所仓单 (手)	1,600.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	98.5	+3.98↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	793	+8↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	777	+8↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	685	0.00	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	85	-17↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	95.00	-0.60↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.13	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	776	-4↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,553.30	+214.90↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,395.30	+57.90↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	14,036.46	+220.47↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,867.11	+23.81↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,124.00	+227.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	20.00	+1.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	65.26	+0.45↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	285.58	+8.76↑
	BDI指数	1,086.00	+84.00↑			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.77	+0.21↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.65	+0.35↑
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	80.85	+0.71↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	86.83	+1.56↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,143	-930↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	41.15	+1.66↑	标的历史40日波动率(日, %)	53.22	+0.73↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	39.08	+5.17↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	37.70	+10.76↑
行业消息	1、发改委: 接续政策从供需两端协同发力, 着力扩大有效需求 2、Mysteel统计全国45个港口进口铁矿库存为14036.46, 环比增220.47; 日均疏港量287.16增4.07。分量方面, 澳矿6524.43增90.78, 巴西矿4670.02增35.55; 贸易矿8393.52增63.86, 球团599.94降8.8, 精粉939.05增49.56, 块矿2136.34增41.37, 粗粉10361.13增138.34; 在港船舶数80条降2条。(单位: 万吨)					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2301合约减仓上行, 进口铁矿石现货报价上调。发改委表示, 接续政策从供需两端协同发力, 着力扩大有效需求, 叠加国际油价反弹带动大宗商品价格走高, 另外I2301合约在连续下滑后, 主流空单明显减仓支撑矿价进一步反弹。当前铁矿石港口库存由降转增, 但钢厂高炉开工率继续提升, 也将增加铁矿石现货需求。技术上, I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上反弹。操作上建议, 短线考虑于665上方偏多交易。					 更多观点请咨询!
重点关注	周五铁矿石港口库存、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!

备注: I: 铁矿石