

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)	769.00	-19.00↓	I 主力合约持仓量(手)	671,059	+17258↑
	I 5-9合约价差(元/吨)	110	+10.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	41408	+705↑
	I 大商所仓单(手)	1,400.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	116.6	-1.63↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	940	-9↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	929	-10↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	803	-14↓	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	160	+9↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	120.75	-1.25↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.41	+0.03↑
	进口成本预估值(元/吨)	967	-12↓			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,352.10	-309.70↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,321.30	+50.20↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,152.98	-308.26↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,183.15	+54.28↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,022.90	+963.90↑	铁矿石可用天数(周, 天)	18.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	59.64	+1.70↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	157.80	-12.10↓
	BDI指数	1,463.00	-44.00↓	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	8.055	+0.07↑
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	21.90	-0.32↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.30	+0.43↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.20	+0.64↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,789	+335↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	44.94	+0.01↑	标的历史40日波动率(日, %)	36.47	+0.27↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	27.70	+1.42↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	27.06	+0.39↑
行业消息	1、4月3日-4月9日中国47港到港总量2321.3万吨，环比减少50.2万吨；中国45港到港总量2269.4万吨，环比增加12.7万吨；北方六港到港总量为1177.8万吨，环比增加81.5万吨。 2、4月3日-4月9日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2352.1万吨，环比减少309.7万吨。澳洲发运量1831.5万吨，环比减少111.2万吨，其中澳洲发往中国的量1525.5万吨，环比减少105.4万吨。巴西发运量520.6万吨，环比减少198.5万吨。					
观点总结	周四I2309合约增仓下行，进口铁矿石现货报价下调。随着钢价持续下滑，钢厂利润收缩挤压矿价，市场情绪相对悲观。另外贸易商报盘较积极，报价随行就市，投机需求少；钢厂方面按需采货，谨慎多观望，保持低库存运行。关注周五铁矿石港口库存变化。技术上，I2309合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议，反弹择机抛空，注意风险控制。					
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！

备注：I：铁矿石



更多资讯请关注！



更多观点请咨询！