

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)	976.50	-17.00↓	I 主力合约持仓量(手)	697,344	-28269↓
	I 1-5合约价差(元/吨)	39	-5.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	69404	+7250↑
	I 大商所仓单(手)	2,200.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	133.35	-1.32↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,064	-1↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,050	+2↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	941	+11↑	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	74	+19↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	136.00	+2.05↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.03	-0.02↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,124	+16↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,662.50	+521.60↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,503.00	+402.80↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	11,223.60	-81.89↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,054.10	+47.53↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,938.00	-180.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	20.00	0.00
	全国186座矿山开工率(旬, %)	68.94	+0.97↑	全国186座矿山日产量(旬, 万吨)	43.49	+0.61↑
下游情况	BDI指数	1,755.00	-41.00↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.44	-0.43↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	21.54	-0.43↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	79.65	-1.38↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	87.99	-1.22↓
期权市场	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,909	-302↓			
	标的历历史20日波动率(日, %)	17.48	+2.15↑	标的历历史40日波动率(日, %)	24.48	+0.44↑
行业消息	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	28.21	+1.70↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	27.76	+0.08↑
	1、国家发展改革委、市场监管总局、中国证监会将紧盯市场动态，持续加强铁矿石期现货联动监管，严厉打击违法违规行为，切实维护市场正常秩序。 2、23日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2561.93万吨，环比上期增156.86万吨。烧结粉总日耗112.9万吨，增1.61万吨。库存消费比22.69，增1.08。					
观点总结	周四I2401合约减仓回调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量增加，将提升铁矿石现货供应。针对近期铁矿石价格出现连续过快上涨的异动情况，国家发展改革委价格司、市场监管总局价监竞争局、中国证监会期货部组织部分铁矿石贸易企业和期货公司召开会议，严厉打击违法违规行为，切实维护市场正常秩序，市场情绪受挫，期价承压回落。贸易商出货积极性尚可，价格多随行就市，而个别钢厂按需补库，因行情波动钢厂多谨慎询盘。技术上，I2401合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向调整。操作上建议，日内短线交易，注意风险控制。					
	重点关注	周五国内铁矿石港口库存、厂内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！

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444
 助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823
 王世霖 期货从业资格号F03118150

备注: I: 铁矿石
 期货投资咨询从业证书号Z0013101
 王凯慧 期货从业资格号F03100511



更多资讯请关注！

免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，瑞达期货股份有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。