

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)	873.50	+8.50↑	I 主力合约持仓量(手)	829,483	+46119↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	35	+6.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	54229	-3169↓
	I 大商所仓单 (手)	5,300.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	128.2	+1.83↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	962	+5↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	938	+9↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	817	+7↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	65	+0↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	127.40	+0.40↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.49	-0.03↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,009	+2↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,408.50	+214.60↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,586.50	+109.60↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,725.83	+524.11↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,228.29	-1143.85↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,086.00	-799.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	20.00	-7.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	51.96	-3.84↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	214.47	+0.85↑
	BDI指数	676.00	-1.00↓			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.88	+0.19↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.3	+0.02↑
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	76.69	+0.72↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	84.15	+1.05↑
	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, %)	31.92	+0.02↑	标的历史40日波动率(日, %)	31.00	-0.95↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	32.60	+0.05↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	33.11	-0.43↓
行业消息	1、Mysteel统计全国45个港口进口铁矿库存为13725.83, 环比增524.11; 日均疏港量250.83降73.73。分量方面, 澳矿6426.60增332.17, 巴西矿4781.39增31.18; 贸易矿8167.43增330.53, 球团624.60增26.29, 精粉1130.66增69.38, 块矿2106.84增103.18, 粗粉9863.73增325.26; 在港船舶数104条降16条。(单位: 万吨) 2、Mysteel调研247家钢厂高炉开工率76.69%, 环比上周增加0.72%, 同比去年增加1.83%; 高炉炼铁产能利用率84.15%, 环比增加1.05%, 同比增加2.64%; 钢厂盈利率32.47%, 环比增加5.20%, 同比下降50.65%; 日均铁水产量226.57万吨, 环比增加2.83万吨, 同比增加7.22万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2305合约高开低走, 进口铁矿石现货报价上调。本期铁矿石港口库存明显增加, 由于钢厂以消耗厂库为主。目前部分贸易商看好后市钢厂补库预期, 低价出货意愿不强, 多有挺价情绪; 钢厂高炉开工率小幅回升, 但多数钢厂厂内库存尚可维持正常生产, 对现货需求较低。短线期价或陷高位整理。技术上, I2305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, 日内短线交易, 注意风险控制。					 更多观点请咨询!
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