

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 | 主力合约收盘价(元/吨) | 687.00 | +0.50↑ | 主力合约持仓量(手) | 758,608 | -8964↓ |
| | I 1-5合约价差(元/吨) | 39 | +3.00↑ | I 合约前20名净持仓(手) | -41708 | -6287↓ |
| | 大商所仓单(手) | 3,000.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨) | 92.35 | +0.74↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 788 | 0.00 | 青岛港61%麦克粉矿(元/干吨) | 767 | -7↓ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 696 | -8↓ | I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 80 | -7↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 93.75 | -2.40↓ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 4.21 | +0.08↑ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 788 | -19↓ | | | |
| 产业情况 | 澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,471.90 | +19.80↑ | 中国45港到港总量(周, 万吨) | 2,252.10 | -456.30↓ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 12,992.70 | +30.85↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 9,396.87 | +68.44↑ |
| | 铁矿石进口量(月, 万吨) | 9,621.00 | +497.00↑ | 铁矿石可用天数(周, 天) | 21.00 | +2.00↑ |
| | 全国126座矿山开工率(旬, %) | 57.81 | -4.75↓ | 全国126座矿山库存量(旬, 万吨) | 250.00 | -0.39↓ |
| | BDI指数 | 1,843.00 | +5.00↑ | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 9.27 | +0.02↑ |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 23.32 | +0.09↑ | | | |
| | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 82.62 | -0.88↓ | 247家钢厂高炉产能用率(周, %) | 89.04 | +0.06↑ |
| | 国内粗钢产量(月, 万吨) | 8,387 | +244↑ | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日, %) | 23.60 | -0.40↓ | 标的历史40日波动率(日, %) | 33.64 | -0.76↓ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 32.17 | -0.16↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 30.37 | -1.95↓ |
| 行业消息 | 1、10月10日-10月16日中国47港到港总量2252.1万吨, 环比减少456.3万吨; 中国45港到港总量2112.5万吨, 环比减少541.2万吨; 北方六港到港总量为964.0万吨, 环比减少301.6万吨。 2、10月10日-10月16日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2471.9万吨, 环比增加19.8万吨。澳洲发运量1792.7万吨, 环比增加12.2万吨, 其中澳洲发往中国的量1591.1万吨, 环比增加207.7万吨。巴西发运量679.2万吨, 环比增加7.6万吨。 | | | | | |
| 观点总结 | 周二I2301合约宽幅整理, 进口铁矿石现货报价稳中有降。贸易商报盘积极性一般, 市场交投仍然冷清, 其中个别钢企有采购需求, 其余钢企多处于观望状态。当前, 由于钢厂利润微薄, 生产积极性欠佳, 采购需求偏低, 造成买方低价采购意愿高, 但本期铁矿石到港量大幅减少或限制矿价下行空间。技术上, I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上建议, 短线于675-700区间低买高抛, 止损8元/吨。 | | | | | |
| 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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!