

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)   | 661.50    | -1.00↓   | 主力合约持仓量(手)           | 728,757  | -7674↓   |
|      | 1-5合约价差(元/吨)   | 25.5      | -6.50↓   | 合约前20名净持仓(手)         | -23401   | +3305↑   |
|      | 大商所仓单(手)   | 1,500.00  | 0.00     |                      |          |          |
|      | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)  | 86.25     | +0.30↑   |                      |          |          |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)   | 728       | +22↑     | 青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)     | 712      | +20↑     |
|      | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)   | 611       | +13↑     | 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)   | 50       | +21↑     |
|      | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨)   | 88.05     | +4.30↑   | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)  | 4.24     | -0.04↓   |
|      | 进口成本预估值(元/吨)   | 754       | +33↑     |                      |          |          |
| 产业情况 | 澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)  | 2,624.90  | -42.60↓  | 中国45港到港总量(周, 万吨)     | 2,331.30 | -371.70↓ |
|      | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)   | 13,193.46 | +249.24↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)    | 9,375.09 | -38.36↓  |
|      | 铁矿石进口量(月, 万吨)  | 9,497.50  | -473.50↓ | 铁矿石可用天数(周, 天)        | 19.00    | 0.00     |
|      | 全国126座矿山开工率(旬, %)  | 52.66     | -1.50↓   | 全国126座矿山库存量(旬, 万吨)   | 243.22   | +1.62↑   |
| 下游情况 | BDI指数  | 1,323.00  | +33.00↑  | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 7.932    | +0.03↑   |
|      | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)   | 19.43     | +0.10↑   |                      |          |          |
|      | 247家钢厂高炉开工率(周, %)  | 78.77     | -2.71↓   | 247家钢厂高炉产能用率(周, %)   | 86.31    | -1.33↓   |
|      | 国内粗钢产量(月, 万吨)  | 8,695     | +308↑    |                      |          |          |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日, %)   | 33.93     | -1.65↓   | 标的历史40日波动率(日, %)     | 31.30    | 0.00     |
|      | 平值看涨期权隐含波动率(日, %)  | 30.80     | -0.65↓   | 平值看跌期权隐含波动率(日, %)    | 29.92    | -1.90↓   |
| 行业消息 | 1、10月31日-11月6日 Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2624.9万吨, 环比减少42.6万吨。澳洲发运量2037.7万吨, 环比增加244.5万吨, 其中澳洲发往中国的量1674.0万吨, 环比增加44.4万吨。巴西发运量587.2万吨, 环比减少287.1万吨。<br>2、10月31日-11月6日 中国47港到港总量2331.3万吨, 环比减少371.7万吨; 中国45港到港总量2274.9万吨, 环比减少291.8万吨; 北方六港到港总量为906.1万吨, 环比减少421.5万吨。 |           |          |                      |          |          |
|      |  |           |          |                      |          |          |
| 观点总结 | 周一I2301合约冲高回调, 进口铁矿石现货市场报价上调。本期澳洲铁矿石发运总量均出现下滑, 将缓解供应压力, 贸易商报价积极性尚可, 部分贸易商有出来询货, 市场交投氛围一般。当前部分钢厂因亏损进行自主检修, 对于铁矿的需求有所下滑, 导致铁矿石现货价格缺乏一定的支撑。短线行情仍有反复, 注意操作节奏。技术上, I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA高位整理。操作上建议, 日内短线交易, 注意风险控制。  |           |          |                      |          |          |
|      |  |           |          |                      |          |          |
| 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!