



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	I 主力合约收盘价 (元/吨)	725.00	-20.50↓	I 主力合约持仓量(手)	724,066	-43005↓
	I 1-5合约价差 (元/吨)	34	-2.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	30942	-11518↓
	I 大商所仓单 (手)	1,900.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	94.95	-3.70↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	804	+8↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	786	+2↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	671	+1↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	61	+23↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	96.25	-2.85↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.74	-0.05↓
	进口成本预估值(元/吨)	814	-18↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,667.30	+308.60↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,431.90	+220.70↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,319.04	+60.27↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,067.08	-247.73↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,498.00	-473.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	20.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	57.59	+4.93↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	234.78	-8.44↓
	BDI指数	1,177.00	-12.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	0.00	-17.79↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	0	-7.83↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	76.35	-0.86↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	83.36	-0.73↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,976	-719↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	36.59	+0.59↑	标的历史40日波动率(日, %)	31.73	+0.05↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	38.72	-2.49↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	41.29	+0.73↑
行业消息	1、11月14日-11月20日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2667.3万吨，环比增加308.6万吨。澳洲发运量1889.8万吨，环比增加165.0万吨，其中澳洲发往中国的量1552.5万吨，环比减少2.6万吨。巴西发运量777.5万吨，环比增加143.7万吨。 2、11月14日-11月20日中国47港到港总量2431.9万吨，环比减少220.7万吨；中国45港到港总量2293.3万吨，环比减少265.6万吨；北方六港到港总量为973.6万吨，环比减少450.1万吨。					 更多资讯请关注！
观点总结	周二I2301合约减仓回落，进口铁矿石现货市场报价平稳。美联储官员发表鹰派言论，叠加印度财政部下调铁矿石出口关税，部分钢铁产品也相应调整，继续利空矿价。贸易商报盘积极性尚可，但出货情况较差，目前钢厂利润水平虽有所修复，但仍处于亏损边缘，加之自身库存尚可维持正常生产，对市场需求较小。短线铁矿石高位承压力度加大。技术上，I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议，750附近空单继续持有，向上突破737则止出场。					 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