

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)	669.50	-10.00↓	主力合约持仓量(手)	756,560	+10865↑
	1-5合约价差(元/吨)	37	-2.00↓	合约前20名净持仓(手)	-35933	-3136↓
	大商所仓单(手)	3,000.00	-500.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	88.8	-1.86↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	774	-16↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	762	-17↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	679	-11↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	92	-7↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	93.00	+1.60↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.19	+0.09↑
	进口成本预估值(元/吨)	788	+17↑			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,511.60	+39.70↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,464.80	+212.70↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,912.76	-79.94↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,431.38	+34.51↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,971.00	+350.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	18.00	-3.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	54.16	-3.65↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	241.60	-8.40↓
下游情况	BDI指数	1,797.00	-22.00↓	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	9.45	-0.02↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	21.02	-0.11↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.05	-0.57↓	247家钢厂高炉产能用率(周, %)	88.26	-0.78↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,695	+308↑			
期权市场	标的历历史20日波动率(日, %)	26.00	+0.18↑	标的历历史40日波动率(日, %)	31.28	-0.31↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.13	-1.71↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.32	-1.35↓
行业消息	1、10月17日-10月23日中国47港到港总量2464.8万吨, 环比增加212.7万吨; 中国45港到港总量2368.4万吨, 环比增加255.9万吨; 北方六港到港总量为1246.5万吨, 环比增加282.5万吨。 2、10月25日, 据Mysteel调研, 东北某钢厂于10月23日新增复产一条棒线。目前东北钢厂螺纹4家停产(长流程1家、短流程3家), 3家开工率不足100%, 线材6家停产(长流程3家、短流程3家), 3家开工率不足100%。					
观点总结	周二I2301合约增仓下行, 进口铁矿石现货报价下调。贸易商报价积极性较差, 市场交易氛围并未起色; 目前部分钢企有采购需求, 其余多持观望状态。由于钢厂利润持续低迷, 铁水对原料价格的支撑逐渐走弱。另外昨日公布的9月份中国部分经济数据向好, 但复苏基础尚不稳固, 市场情绪整体较为悲观。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, 谨慎偏空交易, 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!