

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)	925.00	-10.50↓	I 主力合约持仓量(手)	718,099	-14845↓
	I 9-1合约价差 (元/吨)	62.5	-2.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	4184	-328↓
	I 大商所仓单 (手)	2,100.00	+300.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	145	+0.60↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	1,082	+13↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	1,062	+3↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	870	+11↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	137	+14↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	143.65	0.00	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.72	-0.01↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,118	-7↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,477.20	+14.80↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,296.50	-207.30↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,233.80	-220.00↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,719.18	-129.97↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	8,606.00	-122.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	24.00	-2.00↓
	全国126座矿山产能利用率(旬, %)	64.81	+1.95↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	230.63	+16.88↑
	BDI指数	2,633.00	+67.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	32.61	+1.05↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	13.641	+1.09↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.68	-0.15↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.90	+0.64↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,278	+448↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	46.89	-4.40↓	标的历史40日波动率(日, %)	54.66	-0.50↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	43.47	-0.09↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	45.41	+1.98↑
行业消息	1、Mysteel统计全国45个港口进口铁矿库存为13233.80, 环比降220; 日均疏港量323.42增5.38。分量方面, 澳矿6158.63降58.47, 巴西矿4386.00降217, 贸易矿7503.65降159.55。(单位: 万吨) 2、Mysteel统计全国钢厂进口铁矿石库存总量为10719.18万吨, 环比减少129.97万吨; 当前样本钢厂的进口矿日耗为296.29万吨, 环比增加0.22万吨, 库存消费比36.18, 环比减少0.47天。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2209合约冲高回调。近期铁矿石港口库存持续下滑, 而期货仍贴水于现货, 贸易商由于持货成本较高, 挺价情绪较浓。但节后钢企多以观望为主, 自有库存尚可维持正常生产, 采购需求一般。因此短线行情或有反复, 注意操作节奏。技术上, I2209合约1小时MACD指标显示DIFF 与DEA高位回调。操作上建议, 短线于940-900区间高抛低买, 止损10元/吨。					 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