



撰写人：许方莉 从业资格证号：F3073708 投资咨询从业证书号：Z0017638

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)	697.50	-1.00↓	I 主力合约持仓量(手)	778,003	+188↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	124.5	-17.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	-19046	-1302↓
	I 大商所仓单 (手)	1,600.00	+300.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	98.65	-0.79↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	830	-27↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	820	-23↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	687	-18↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	123	-22↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	104.05	-2.15↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.51	+0.03↑
	进口成本预估值(元/吨)	843	-16↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,579.00	+181.30↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,351.50	+142.30↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,736.28	-150.71↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,840.76	-452.53↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,023.00	+964.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	-3.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	62.04	-0.06↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	143.98	+3.51↑
	BDI指数	1,545.00	-13.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.34	-0.17↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.715	-0.04↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	81.69	-0.87↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.49	-1.14↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,573	+1784↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	42.54	+0.14↑	标的历史40日波动率(日, %)	35.55	-0.25↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.75	-0.10↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	30.92	+0.35↑
行业消息	1、Mysteel统计全国45个港口进口铁矿库存为12736.28, 环比降150.71; 日均疏港量303.16降21.00。分量方面, 澳矿5970.43降150.69, 巴西矿4301.25增5.03; 贸易矿7491.24增57.24。 2、Mysteel调研247家钢厂高炉开工率81.69%, 环比上周下降0.87%, 同比去年下降0.22%; 高炉炼铁产能利用率89.49%, 环比下降1.14%, 同比增加1.74%。					 <div>更多资讯请关注!</div>
观点总结	周五I2309合约先抑后扬, 进口铁矿石现货报价下调。本期铁矿石港口库存继续下滑, 且低于去年同期1500万吨, 但钢厂高炉开工率及产能利用同样下调将减少铁矿石现货需求。钢厂方面节前补库, 库存可用天数尚可, 节后保持按需采货, 交投品种多以PB粉、金布巴、混合粉为主。整体上, 钢市低迷, 钢厂利润收缩将继续挤压矿价。技术上, I2309合约1小时MACD 指标显示DIFF与DEA低位整理。操作上建议, 日内短线交易, 注意风险控制。					 <div>更多观点请咨询!</div>
重点关注						