



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) | 788.00 | -10.50↓ | I 主力合约持仓量(手) | 653,801 | +17334↑ |
| | I 5-9合约价差 (元/吨) | 100 | +3.00↑ | I 合约前20名净持仓(手) | 40703 | -11100↓ |
| | I 大商所仓单 (手) | 1,400.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨) | 118.25 | -1.50↓ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨) | 949 | +6↑ | 青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨) | 938 | +7↑ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨) | 817 | +1↑ | I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约) | 150 | +18↑ |
| | 铁矿石62%普氏指数 (美元/吨) | 122.00 | +2.35↑ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.37 | -0.03↓ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 979 | +18↑ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,352.10 | -309.70↓ | 中国45港到港总量(周, 万吨) | 2,321.30 | +50.20↑ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 13,152.98 | -308.26↓ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 9,183.15 | +54.28↑ |
| | 铁矿石进口量(月, 万吨) | 9,059.00 | -1301.00↓ | 铁矿石可用天数(周, 天) | 18.00 | +1.00↑ |
| | 全国126座矿山开工率(旬, %) | 59.64 | +1.70↑ | 全国126座矿山库存量(旬, 万吨) | 157.80 | -12.10↓ |
| | BDI指数 | 1,507.00 | -53.00↓ | | | |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 22.22 | -0.60↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 7.985 | -0.60↓ |
| 下游情况 | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 84.30 | +0.43↑ | 247家钢厂高炉产能利用率(周, %) | 91.20 | +0.64↑ |
| | 国内粗钢产量(月, 万吨) | 7,789 | +335↑ | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日, %) | 44.93 | +0.04↑ | 标的历史40日波动率(日, %) | 36.20 | -0.21↓ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 26.28 | +0.20↑ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 26.67 | +0.37↑ |
| 行业消息 | 1、4月3日-4月9日中国47港到港总量2321.3万吨，环比减少50.2万吨；中国45港到港总量2269.4万吨，环比增加12.7万吨；北方六港到港总量为1177.8万吨，环比增加81.5万吨。 2、4月3日-4月9日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2352.1万吨，环比减少309.7万吨。澳洲发运量1831.5万吨，环比减少111.2万吨，其中澳洲发往中国的量1525.5万吨，环比减少105.4万吨。巴西发运量520.6万吨，环比减少198.5万吨。 | | | | |  <div>更多资讯请关注！</div> |
| 观点总结 | 周三I2309合约震荡偏弱。本期澳巴铁矿石发运总量明显下滑，同时到港量再度下降，整体上铁矿石现货供应减少。贸易商出货意愿尚可，以适价出货为主；钢厂多谨慎观望，实盘询货较少。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 | | | | | | |