


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)	714.00	-7.50↓	I 主力合约持仓量(手)	782,628	+49451
	I 5-9合约价差 (元/吨)	143	+13.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	-15552	+65371
	I 大商所仓单 (手)	1,600.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	105.4	+6.63↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	848	+51	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	838	+101
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	702	+51	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	124	+171
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	109.95	+6.30↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.50	-0.01↓
	进口成本预估值(元/吨)	890	+501			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,615.40	+36.50↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,149.50	+271.50↑
	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)	9,044.20	-978.80↓	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	1,558.00	+13.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.32	-0.03↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.91	+0.20↑
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, %)	28.43	-17.13↓	标的历史40日波动率(日, %)	36.56	-0.05↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.73	+1.18↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	30.11	0.00
行业消息	1、5月1日-5月7日中国47港到港总量2149.5万吨，环比增加271.5万吨；中国45港到港总量2067.3万吨，环比增加258.5万吨；北方六港到港总量为970.9万吨，环比增加181.5万吨。 2、4月中国进口铁矿砂及其精矿9044.2万吨，较上月减少978.7万吨，环比下降9.8%；1-4月累计进口铁矿砂及其精矿38468.4万吨，同比增长8.6%。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周二I2309合约反弹受阻，进口铁矿石现货报价小幅上调。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继续下调将减少铁矿石现货需求。贸易商报价积极性一般，钢厂采购较为谨慎，整体交投情绪一般。技术上，I2309合约1小时MACD 指标显示DIFF与DEA运行于0轴附近。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						