

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)	698.50	0.00	I 主力合约持仓量(手)	721,508	+5041
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	34.5	0.00	I 合约前20名净持仓(手)	-24879	+48421
	I 大商所仓单 (手)	1,900.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	96.25	+0.18↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	797	-5↓	青岛港60.8%麦克粉矿 (元/干吨)	775	-7↓
	京唐港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	679	-11↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	77	-7↓
	铁矿石62%普氏指数 (前一日, 美元/吨)	96.45	-1.20↓	江苏废钢/青岛港60.8%麦克粉矿	3.52	+0.02↑
	进口成本预估值(元/吨)	799	-10↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	3,188.70	-159.10↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,344.10	+63.70↑
	45港铁矿石库存量(周, 万吨)	13,987.83	-178.26↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,925.48	-35.68↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,314.00	+917.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	18.00	-5↓
	266座矿山日产量(周, 万吨)	42.44	+0.78↑	266座矿山开工率(周, %)	66.95	+0.54↑
	266座矿山铁精粉库存(周, 万吨)	59.40	-4.01↓	BDI指数	1,296.00	+6.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.92	+0.08↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.41	-0.12↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.67	-0.46↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.30	-0.44↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,602	-682↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	20.57	-0.68↓	标的历史40日波动率(日, %)	24.07	0.00
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	17.64	-0.02↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	17.20	-0.95↓
行业消息	1、5月26日, 中国47港进口铁矿石库存总量14463.79万吨, 较上周一下降163.84万吨; 45港库存总量13858.79万吨, 环比下降196.84万吨。 2、5月19日-5月25日, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1417.4万吨, 环比增加41.1万吨, 呈现小幅累库态势, 当前库存绝对量已达年初以来的最大值。					 更多资讯请关注!
观点总结	周三I2509合约再显抗跌。宏观方面, 由于贸易紧张局势有所缓和, 美国消费者信心指数在5月份从近五年低点大幅反弹, 结束了连跌趋势。供需情况, 本期铁矿石发运减少, 到港增加, 国内港口库存继续下滑; 钢厂高炉开工率-0.46%, 铁水产量-1.17万吨, 铁水有继续下滑预期, 需求支撑减弱。整体上, 黑色板块疲软, 或继续拖累矿价。技术上, I2509合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上, 反弹抛空, 注意节奏和风险控制。					
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

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101

免责声明
本报告中的信息均来源于公开可获得资料, 瑞达期货股份有限公司力求准确可靠, 但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证, 据此投资, 责任自负。本报告不构成个人投资建议, 客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有, 未经书面许可, 任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发, 需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院, 且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。