

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)	865.50	-22.50↓	I 主力合约持仓量(手)	450,886	-20004↓
	I 5-9合约价差 (元/吨)	44.5	+45.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	2733	-4806↓
	I 大商所仓单 (手)	2,600.00	+200.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	114.85	-2.19↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	933	-10↓	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	910	-11↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	787	+16↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	44	+12↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	117.25	+0.65↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.46	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	971	+6↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,445.60	-241.70↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,203.60	-264.50↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	14,671.51	-91.13↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,323.52	-202.60↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,181.80	+109.80↑	铁矿石可用天数(周, 天)	18.00	-6↓
	全国186座矿山日产量(旬, 万吨)	43.24	-0.41↓	全国186座矿山开工率(旬, %)	68.43	-0.82↓
	全国186座矿山库存(旬, 万吨)	80.89	-19.07↓	BDI指数	2,066.00	-63.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	26.98	-0.31↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.56	-0.03↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	81.52	+0.90↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	87.69	+1.43↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,827	+2083↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	33.67	+1.40↑	标的历史40日波动率(日, %)	39.58	+0.60↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	28.75	+0.93↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	28.55	+1.57↑
行业消息	1、2024年5月6日-12日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2445.6万吨, 环比减少241.7万吨。澳洲发运量1817.6万吨, 环比减少238.5万吨, 其中澳洲发往中国的量1661.5万吨, 环比减少20.8万吨。巴西发运量627.9万吨, 环比减少3.2万吨。 2、5月6日-5月12日中国47港到港总量2203.6万吨, 环比减少264.5万吨; 中国45港到港总量2146.4万吨, 环比减少234.5万吨; 北方六港到港总量为1251.9万吨, 环比增加21.9万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周二I2409合约减仓回落, 进口铁矿石现货报价下调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均出现下滑。贸易商出货积极性尚可, 报价多实盘单议。钢厂多以按需补库为主, 询盘较为谨慎。随着焦炭现货市场震荡偏弱运行, 叠加钢价下行, 市场情绪相对低迷。技术上, I2409合约1小时 MACD指标显示DIFF与 DEA向下调整。操作上建议, 反弹择机短空, 注意风险控制。					
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。