

| 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) | 894.50 | +3.00↑ | I主力合约持仓量(手) | 426,347 | -11756↓ |
| | I9-1合约价差(元/吨) | 19 | -8.50↓ | I合约前20名净持仓(手) | -8857 | -8256↓ |
| | I大商所仓单(手) | 3,700.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨) | 118.6 | +1.21↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 949 | +5↑ | 天津港61%麦克粉矿(元/干吨) | 927 | +6↑ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 793 | +11↑ | I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 32 | +3↑ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 118.00 | +1.10↑ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.35 | -0.05↓ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 977 | +9↑ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨) | 2,455.60 | +10.00↑ | 中国47港到港总量(周,万吨) | 3,028.60 | +825.00↑ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周,万吨) | 14,809.20 | +137.69↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨) | 9,271.86 | -51.66↓ |
| | 铁矿石进口量(月,万吨) | 10,182.00 | +110.00↑ | 铁矿石可用天数(周,天) | 18.00 | 0.00 |
| | 全国186座矿山日产量(旬,万吨) | 42.95 | -0.29↓ | 全国186座矿山开工率(旬,%) | 67.75 | -0.68↓ |
| | 全国186座矿山库存(旬,万吨) | 70.50 | -10.39↓ | BDI指数 | 1,844.00 | +27.00↑ |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 25.07 | +0.53↑ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 10.61 | +0.30↑ |
| 下游情况 | 247家钢厂高炉开工率(周,%) | 81.52 | 0.00 | 247家钢厂高炉产能利用率(周,%) | 88.59 | +0.90↑ |
| | 国内粗钢产量(月,万吨) | 8,594 | -233↓ | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日,%) | 27.93 | -5.23↓ | 标的历史40日波动率(日,%) | 38.35 | -0.48↓ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日,%) | 27.98 | -0.52↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 28.21 | +0.18↑ |
| 行业消息 | 1、5月13日-5月19日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2455.6万吨,环比增加10.0万吨。澳洲发运量1751.3万吨,环比减少66.3万吨,其中澳洲发往中国的量1517.3万吨,环比减少144.2万吨。巴西发运量704.3万吨,环比增加76.3万吨。 2、5月13日-5月19日中国47港到港总量3028.6万吨,环比增加825.0万吨;中国45港到港总量2847.1万吨,环比增加700.7万吨;北方六港到港总量为1439.8万吨,环比增加187.9万吨。 | | | | |  <p>更多资讯请关注!</p> |
| 观点总结 | 周一I2409合约冲高回调,进口铁矿石现货报价上调。贸易商报价积极性尚可,价格相对坚挺,钢厂按需补库。由于钢厂高炉产能利用率继续提升,247家钢厂日均铁水产量升至236.89万吨,连续七周增加,同时利好政策提振市场信心,只是本期澳巴铁矿石到港量明显增加,叠加国内铁矿石港口库存继续提升,整体上现货供应相对宽松或造成扰动。技术上,I2409合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上走高。操作上建议,震荡偏多交易,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。