


项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	主力合约收盘价(元/吨)	762.00	-14.00↓	主力合约持仓量(手)	438,952	+8758↑
	1-5合约价差(元/吨)	6.5	-1.00↓	合约前20名净持仓(手)	-54559	-2541↓
	大商所仓单(手)	2,200.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	100.8	-2.05↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	816	-37↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	793	-33↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	697	-36↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	31	-19↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	102.80	-3.05↓	铁废价差	28.00	-85.00↓
	进口成本预估值(元/吨)	864	-21↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	2,644.10	-28.90↓	中国47港到港总量(周,万吨)	2,490.30	+138.40↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	15,272.48	-150.88↓	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,130.51	+132.61↑
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,383.80	-29.20↓	铁矿石可用天数(周,天)	17.00	0.00
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	41.11	+0.08↑	全国186座矿山开工率(旬,%)	65.34	+0.09↑
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	38.56	+2.27↑	BDI指数	1,405.00	+44.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.85	+0.66↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.35	+0.35↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	82.27	-0.19↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	87.85	-0.53↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	7,707	-85↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	233.99	-1.42↓
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	30.21	+0.03↑	标的历史40日波动率(日,%)	42.25	+0.07↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	33.11	-2.01↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	31.91	-3.13↓
行业消息	<p>1.上海证券报:过去两个月来看,M2增速累计升高1.2个百分点,有市场专家分析称,主要有三方面因素:一是债市和理财资金开始向存款回流,投资者风险偏好由避险情绪主导转向更为积极的资产配置;二是随着支持资本市场稳定发展两项工具正式推出落地,商业银行向非银机构的融资增多,对派生增加M2产生了直接的推动作用;三是财政支出加快,财政存款更多转化为企业存款。</p> <p>2.狭义货币(M1)增速跌幅收窄,为年内首次。10月末,M1余额63.34万亿元,同比下降6.1%。专家认为,M1增速边际回升,既反映出增量政策加快推进的背景下,经济活动企稳向好,也受益于金融市场上投资者风险偏好提升。</p>					 <p>更多资讯请关注!</p>
观点总结	<p>11月11日,铁矿2501合约收盘762,下跌2.87%。宏观面,预期落地,铁矿短期或由基本面定价为主。基本面,供应维持宽松,铁水需求季节性回落,本期铁水产量234.06万吨,环比下降1.41万吨,年同比降4.66万吨。驱动方面,市场交易逐渐转向冬储逻辑,铁矿跟随成材波动为主。技术上,4小时周期K线位于20和60均线下方,操作上,震荡偏空,请投资者注意风险控制。</p>					
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:1: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
助理研究员:李秋荣 期货从业资格号F03101823
徐玉花 期货从业资格号F03132080

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。