

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)	819.00	-9.00↓	I 主力合约持仓量(手)	730,696	+13058↑
	I 1-5合约价差 (元/吨)	47.5	+3.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	71172	-14133↓
	I 大商所仓单 (手)	2,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	111.15	-1.12↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	968	-20↓	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	962	-15↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	920	-16↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	143	-6↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	116.35	-3.10↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.24	+0.04↑
	进口成本预估值(元/吨)	974	-25↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,371.80	-571.10↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,154.10	-305.80↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	11,387.78	-207.91↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,664.60	-1180.22↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,642.00	+1294.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	15.00	-9↓
	全国186座矿山开工率(旬, %)	68.94	+0.97↑	全国186座矿山日产量(旬, 万吨)	43.49	+0.61↑
	BDI指数	1,991.00	+62.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	26.57	+0.02↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.24	+0.04↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.39	-0.76↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	92.29	-0.81↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,641	-438↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	25.82	+0.24↑	标的历史40日波动率(日, %)	27.67	-15.10↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	27.42	-3.36↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.60	-1.49↓
行业消息	1、力拓预计2024财年皮尔巴拉的铁矿石出货量为3.23亿至3.38亿吨，略高于2023年的预测，原因是运营条件持续改善。此外，力拓集团预计在2023年，皮尔巴拉地区的铁矿石出货量不会有变化，仍然会在3.2亿吨到3.35亿吨之间，而且会接近这个范围的最大值。 2、10月2日-10月8日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2371.8万吨，环比减少571.1万吨。澳洲发运量1850.1万吨，环比减少99.3万吨，其中澳洲发往中国的量1490.7万吨，环比减少255.4万吨。巴西发运量521.7万吨，环比减少471.9万吨。					 更多资讯请关注！
观点总结	周二I2401合约弱势下行，进口铁矿石现货报价下调。本期澳巴铁矿石发运量及到港口量均出现下滑，将减少铁矿石现货供应。贸易商报盘积极性一般，报价多随行就市；钢厂方面，钢厂采购谨慎，多持观望状态，以消耗库存为主。当前成材需求较弱，且铁矿及焦炭价格处在相对高位，导致钢厂利润情况整体欠佳，钢厂向上挤压炉料意愿较高。技术上，I2401合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下运行。操作上建议，震荡偏空交易，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！

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 王凯慧 期货从业资格号F03100511

王世霖 期货从业资格号F03118150

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。