

| 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) | 803.00 | +21.50↑ | 主力合约持仓量(手) | 472,070 | -6590↓ |
| | 5-9合约价差(元/吨) | 26 | +0.50↑ | 合约前20名净持仓(手) | 13543 | +3289↑ |
| | 大商所仓单(手) | 2,500.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨) | 103.35 | +3.44↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 831 | -20↓ | 天津港61%麦克粉矿(元/干吨) | 822 | -23↓ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 707 | -27↓ | 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 19 | -45↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 100.20 | -4.15↓ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.53 | -0.02↓ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 833 | -34↓ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨) | 2,208.00 | -314.40↓ | 中国47港到港总量(周,万吨) | 2,369.30 | +242.80↑ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周,万吨) | 14,282.04 | +134.73↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨) | 9,269.84 | +9.86↑ |
| | 铁矿石进口量(月,万吨) | 9,751.00 | -1443.00↓ | 铁矿石可用天数(周,天) | 20.00 | 0.00 |
| | 全国186座矿山开工率(旬,%) | 63.88 | -0.28↓ | 全国186座矿山日产量(旬,万吨) | 49.88 | -0.22↓ |
| | BDI指数 | 2,374.00 | +24.00↑ | | | |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 31.14 | -0.35↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 12.34 | -0.12↓ |
| | 247家钢厂高炉开工率(周,%) | 76.17 | +0.55↑ | 247家钢厂高炉产能利用率(周,%) | 82.56 | -0.53↓ |
| | 国内粗钢产量(月,万吨) | 6,744 | -866↓ | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日,%) | 34.34 | +2.66↑ | 标的历史40日波动率(日,%) | 29.59 | +0.47↑ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日,%) | 34.52 | +0.20↑ | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 34.72 | +1.24↑ |
| 行业消息 | 1、3月11日-3月17日中国47港到港总量2369.3万吨,环比增加242.8万吨;中国45港到港总量2277.1万吨,环比增加252.4万吨;北方六港到港总量为1072.4万吨,环比增加87.9万吨。 2、3月11日-3月18日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2208.0万吨,环比减少314.4万吨。澳洲发运量1567.4万吨,环比减少328.3万吨,其中澳洲发往中国的量1398.6万吨,环比减少96.9万吨。巴西发运量640.6万吨,环比增加13.9万吨。 | | | | |  <p>更多资讯请关注!</p> |
| 观点总结 | 周一I2405合约减仓反弹。本期澳巴铁矿石发运量减少,但到港量继续增加,整体上供应维持宽松。贸易商报盘积极性尚可,报价随行就市,钢厂询盘谨慎,部分有采购需求,采购品种有PB粉、超特粉、纽曼筛后块等等。由于钢价反弹对炉料构成支撑,同时国内以旧换新和大规模的设备更新政策信号带来提振,短线铁矿石期价波动或有反复,注意操作节奏。技术上,I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位反弹。操作上建议,日内短多,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

备注: I: 铁矿石

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。