


| 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) | 783.50 | +14.00↑ | I主力合约持仓量(手) | 438,698 | -169↓ |
| | I1-5合约价差(元/吨) | 11.5 | +2.00↑ | 合约前20名净持仓(手) | -59617 | -7044↓ |
| | I大商所仓单(手) | 1,500.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨) | 102.95 | +2.05↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 843 | +22↑ | 青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨) | 823 | +21↑ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 723 | +17↑ | I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 39 | +7↑ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 101.20 | +1.95↑ | 铁废价差 | -42.00 | +2.00↑ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 845 | +18↑ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运量(周,万吨) | 2,630.70 | +170.10↑ | 中国47港到港总量(周,万吨) | 2,544.30 | +71.40↑ |
| | 47港铁矿石港口库存量(周,万吨) | 15,337.18 | +36.11↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨) | 8,978.91 | -27.82↓ |
| | 铁矿石进口量(月,万吨) | 10,413.00 | +274.00↑ | 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) | 37.38 | -1.64↓ | 全国186座矿山开工率(旬,%) | 59.40 | -2.84↓ |
| | 全国186座矿山库存(旬,万吨) | 32.95 | -15.15↓ | BDI指数 | 1,480.00 | -7.00↓ |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 21.14 | +0.02↑ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 8.465 | -0.04↓ |
| 下游情况 | 247家钢厂高炉开工率(周,%) | 82.16 | +0.46↑ | 247家钢厂高炉产能利用率(周,%) | 88.51 | +0.50↑ |
| | 国内粗钢产量(月,万吨) | 7,707 | -85↓ | 日均铁水产量(247家)(周,万吨) | 235.75 | +1.33↑ |
| | | | | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日,%) | 50.58 | -1.85↓ | 标的历史40日波动率(日,%) | 44.43 | -0.03↓ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日,%) | 34.19 | +0.63↑ | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 34.05 | -0.15↓ |
| 行业消息 | 1.俄罗斯央行加息200个基点,将基准利率从19%上调至21%,市场预期加息至20%。 | | |  <small>更多资讯请关注!</small> | | |
| | 2.2024年1-9月汽车进口53万台,同比下降4%。随着国产车的崛起和国际品牌本土化加速,近几年汽车进口持续低迷,1-9月持续3年负增长。 | | | | | |
| 观点总结 | 10月28日,铁矿2501合约收盘783.5,上涨2.35%。宏观面,世界银行张文才认为全球经济似乎正处于“软着陆”的最后阶段,同时预测2024年全球经济增长将保持在2.6%,2025年和2026年小幅上升至平均2.7%。基本面,供应维持宽松,本期铁水产量235.69万吨,环比增1.33万吨,年同比降7.04万吨。驱动方面,宏观情绪转好。技术上,4小时K线位于20日和60日均线上方,操作上,震荡偏多对待,请投资者注意风险控制。 | | | | | |
| 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
 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。