

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)	876.50	+4.50↑	I 主力合约持仓量(手)	883,758	+36214↑
	I 1-5合约价差(元/吨)	51	-3.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	54597	-11746↓
	I 大商所仓单(手)	2,500.00	-1300.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	116.55	-0.66↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	994	+2↑	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	976	+2↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	888	0.00	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	99	-2↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	120.00	+4.45↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.15	+0.01↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,003	+36↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,563.20	+1.90↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,472.30	-407.10↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	11,038.92	+195.84↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,078.11	+235.30↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,118.00	-524.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	-4↓
	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↑
下游情况	BDI指数	1,832.00	-117.00↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.15	-0.43↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.17	-0.80↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.36	+0.18↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	90.60	-1.30↓
期权市场	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,211	-431↓			
	标的历历史20日波动率(日, %)	29.80	-0.28↓	标的历历史40日波动率(日, %)	26.19	-0.17↓
行业消息	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	24.43	-0.59↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	25.18	-0.24↓
	1、26日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2388.83万吨, 环比上期降90.25万吨。烧结粉总日耗111.25万吨, 增0.84万吨。库存消费比21.47, 降0.98。 2、唐山市自2023年10月27日12时起全市启动重污染天气Ⅱ级应急响应, 具体解除时间另行通知。邯郸市自10月27日12时起启动重污染天气Ⅱ级应急响应, 解除时间根据会商研判结果另行通知。					
观点总结	周四I2401合约增仓上行, 进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石到港量明显下滑, 将降低铁矿石现货供应。贸易商报价积极性尚可, 报价多随行就市, 个别贸易商适价出货; 钢厂询盘谨慎, 刚需采购, 部分贸易商有投机行为。唐山区域开启新一轮环保限产叠加钢厂利润亏损, 钢厂对于铁矿石的需求或将有所减少, 对矿价支撑减弱。技术上, I2401合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴上方。操作上建议, 日内短线交易, 注意风险控制。					
	重点关注	周五铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率				

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



更多资讯请关注!

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。

