


| 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) | 849.50 | +26.00↑ | 主力合约持仓量(手) | 407,676 | -19026↓ |
| | 5-9合约价差(元/吨) | 36 | +3.50↑ | 合约前20名净持仓(手) | 23122 | +2243↑ |
| | 大商所仓单(手) | 1,700.00 | -800.00↓ | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨) | 109.7 | +3.98↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 865 | -7↓ | 天津港61%麦克粉矿(元/干吨) | 852 | -15↓ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 702 | -27↓ | 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 3 | -41↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 106.50 | -1.40↓ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.56 | +0.06↑ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 884 | -12↓ | | | |
| 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) | 25.00 | +5↑ |
| | 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 | 2,284.00 | -108.00↓ | | | |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 30.49 | -0.67↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 12.26 | -0.90↓ |
| | 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,%) | 35.82 | +2.21↑ | 标的历史40日波动率(日,%) | 31.56 | +1.07↑ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日,%) | 35.12 | -0.33↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 34.66 | -0.92↓ |
| 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、Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2566.79万吨,环比上期增36.45万吨。烧结粉总日耗103.81万吨,增1.23万吨。库存消费比24.73,增0.06。 | | | | |  更多资讯请关注! |
| 观点总结 | 周四I2405合约减仓上行。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。贸易商报价积极性一般,价格方面一般多随行就市,钢厂持观望态度较多,鲜有询盘,采购较为谨慎。随着钢材表观需求持续提升,对于铁矿石现货需求构成支撑,叠加期货空头减仓,期价向上扩大涨幅。技术上,I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上走高。操作上建议,维持偏多交易,注意风险控制。 | | | | |  |
| 重点关注 | 周五国内铁矿石港口库存、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

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。