瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

铁矿石产业链日报

2026/3/11

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）	787.50	+3.50↑	I 主力合约持仓量(手)	474,969	+7004↑
	I 5-9合约价差（元/吨）	29	+2.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	-42200	-1047↓
	I 大商所仓单（手）	2,900.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	104.25	+0.51↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	828	-2↓	青岛港60.5%麦克粉矿 (元/干吨)	816	-1↓
	京唐港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	729	-6↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	28	-5↓
	铁矿石62%普氏指数（前一日，美元/吨）	104.85	+0.30↑	江苏废钢/青岛港60.5%麦克粉矿	3.21	-0.02↓
	进口成本预估值(元/吨)	832	+2↑			
产业情况	全球铁矿石发运总量(周，万吨)	2,897.80	-442.90↓	中国47港到港总量(周，万吨)	2,697.50	+467.50↑
	47港铁矿石库存量(周，万吨)	17,894.83	+3.53↑	样本钢厂铁矿石库存量(周，万吨)	9,011.57	-73.53↓
	铁矿石进口量(月，万吨)	11,965.00	+2201.21↑	铁矿石可用天数(周，天)	21.00	0.00
	266座矿山日产量(周，万吨)	38.60	+1.48↑	266座矿山开工率(周，%)	60.90	+1.87↑
	266座矿山铁精粉库存(周，万吨)	50.17	+8.45↑	BDI指数	1,919.00	-147.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	27.96	+0.26↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.305	-1.57↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周，%)	77.69	-2.55↓	247家钢厂高炉产能用率(周，%)	85.30	-2.18↓
	国内粗钢产量(月，万吨)	6,818	-169↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日，%)	15.55	-0.15↓	标的历史40日波动率(日，%)	17.82	-0.01↓
	平值看涨期权隐含波动率(日，%)	21.45	-1.48↓	平值看跌期权隐含波动率(日，%)	22.79	+0.55↑

行业消息

1、2026年3月2日-3月8日Mysteel全球铁矿石发运总量2897.8万吨，环比减少442.9万吨。澳洲巴西铁矿发运总量2342.1万吨，环比减少348.5万吨。澳洲发运量1753.2万吨，环比减少195.3万吨，其中澳洲发往中国的量1465.9万吨，环比减少105.1万吨。巴西发运量589.0万吨，环比减少153.3万吨。

2、3月2日-8日，澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1317.9万吨，环比增加39.6万吨，库存规模小幅回升。当前库存量处于年初以来的次高位。

更多资讯请关注！

观点总结

周三I2605合约震荡偏强。宏观面，美国、俄罗斯、乌克兰三方会谈将推迟到下周举行。乌克兰总统泽连斯基表示，会谈地点可能在土耳其。供需情况，本期澳巴铁矿石发运量减少，到港量增加，华北钢厂限产，铁水产量下滑，铁矿港口库存继续增加。整体上，钢厂多进行刚需补库，逢低补库为主，询盘较为谨慎。但期货表观较为坚挺，市场认为两会后铁水产量提升将增加铁矿石需求。技术上，I2605合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴上方，绿柱平稳。观点参考，震荡偏多，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！

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

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。