

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)	865.00	-26.00↓	I主力合约持仓量(手)	397,362	-5803↓
	I9-1合约价差(元/吨)	26.5	+10.00↑	I合约前20名净持仓(手)	1656	-1143↓
	I大商所仓单(手)	3,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	115.6	-3.34↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	939	-2↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	915	-1↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	771	0.00	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	50	+251↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	118.75	+0.90↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.43	-0.06↓
	进口成本预估值(元/吨)	984	+7↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨)	2,455.60	+10.00↑	中国47港到港总量(周,万吨)	3,028.60	+825.00↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	14,852.32	+43.12↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,338.93	+67.07↑
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,182.00	+110.00↑	铁矿石可用天数(周,天)	19.00	-3↓
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	42.95	-0.29↓	全国186座矿山开工率(旬,%)	67.75	-0.68↓
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	70.50	-10.39↓	BDI指数	1,790.00	+6.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.34	-0.40↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.97	-0.05↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	81.52	0.00	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	88.51	-0.08↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	8,594	-233↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	26.43	+1.93↑	标的历史40日波动率(日,%)	34.03	-2.72↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	26.90	+1.33↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	24.93	-0.99↓
行业消息	1、2024年继续实施粗钢产量调控;严控低附加值基础原材料产品出口;到2025年底,电炉钢产量占粗钢总产量比例力争提升至15%,废钢利用量达到3亿吨。 2、Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2672万吨,环比上期降81.61万吨。进口烧结粉总日耗111.64万吨,降3.59万吨。库存消费比23.93,增0.04。				 更多资讯请关注!	
观点总结	周四I2409合约减仓回落,进口铁矿石现货报价下调。本期澳巴铁矿石发运量增加,而到港量减少,但国内港口库存维持在1.5亿吨附近,供应仍相对宽松。贸易商交投情绪较低,报价较少,部分钢厂有招标计划,按需采购。关于国务院印发《2024—2025年节能降碳行动方案》,要求2024年继续实施粗钢产量调控,钢厂限产预期对铁矿石现货需求将产生抑制。技术上,I2409合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下运行。操作上建议,日内短线交易,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!

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。