瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

铁矿石产业链日报

2026/3/12

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）	795.50	+8.00↑	I 主力合约持仓量(手)	480,735	+5766↑
	I 5-9合约价差（元/吨）	29	0.00	I 合约前20名净持仓(手)	-37117	+5083↑
	I 大商所仓单（手）	3,200.00	+300.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	107.1	+2.95↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	834	+3↑	青岛港60.5%麦克粉矿 (元/干吨)	821	+4↑
	京唐港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	729	0.00	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	26	-4↓
	铁矿石62%普氏指数（前一日，美元/吨）	105.10	+0.25↑	江苏废钢/青岛港60.5%麦克粉矿	3.19	-0.02↓
	进口成本预估值(元/吨)	834	+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	1,926.00	+7.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	27.95	-0.01↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.67	+0.37↑
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，%)	15.83	+0.28↑	标的历史40日波动率(日，%)	15.93	-1.89↓
	平值看涨期权隐含波动率(日，%)	25.48	+4.03↑	平值看跌期权隐含波动率(日，%)	24.61	+1.82↑

行业消息

1、由于近期霍尔木兹海峡局势问题，多艘原本目的地为中东的铁矿石货船已改变航线，转而前往中国。数据显示，目前已有四起船舶改道事件。

2、Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2742.38万吨，环比上期减88.58万吨。进口烧结粉总日耗101.66万吨，环比上期减1.69万吨。库存消费比26.98，环比上期减0.41。

更多资讯请关注！

观点总结

周四I2605合约保持强势。伊朗总统佩泽希齐扬表示，结束当前由美国和以色列挑起的战争的“唯一途径”，是承认伊朗的合法权利、支付战争赔偿，并由国际社会提供防止未来侵略行为的坚定保障。供需情况，本期澳巴铁矿石发运量减少，到港量增加，铁矿港口库存继续提升；随着两会结束，铁水产量增加预期提升铁矿石现货需求。另外，国际油价企稳反弹将再度推高运费对矿价构成支撑。技术上，I2605合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴上方，红柱平稳。观点参考，震荡偏多，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。