

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)	827.50	+8.50↑	主力合约持仓量(手)	748,753	+18057↑
	1-5合约价差(元/吨)	52	+4.50↑	合约前20名净持仓(手)	82044	+10872↑
	大商所仓单(手)	2,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	112.6	+1.82↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	977	+6↑	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	946	-10↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	920	0.00	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	118	-18↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	114.05	-2.30↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.20	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	955	-19↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,371.80	-571.10↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,154.10	-305.80↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	11,387.78	-207.91↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,664.60	-1180.22↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,642.00	+1294.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	15.00	-9↓
	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	1,983.00	-8.00↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.16	-0.08↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	26.43	-0.14↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.39	-0.76↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	92.29	-0.81↓
期权市场	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,641	-438↓			
	标的历历史20日波动率(日, %)	26.13	+0.31↑	标的历历史40日波动率(日, %)	27.64	-0.03↓
行业消息	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	26.89	-0.53↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	28.91	-0.69↓
	1、力拓预计2024财年皮尔巴拉的铁矿石出货量为3.23亿至3.38亿吨, 略高于2023年的预测, 原因是运营条件持续改善。此外, 力拓集团预计在2023年, 皮尔巴拉地区的铁矿石出货量不会有变化, 仍然会在3.2亿到3.35亿吨之间, 而且会接近这个范围的最大值。 2、10月2日-10月8日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2371.8万吨, 环比减少571.1万吨。澳洲发运量1850.1万吨, 环比减少99.3万吨, 其中澳洲发往中国的量1490.7万吨, 环比减少255.4万吨。巴西发运量521.7万吨, 环比减少471.9万吨。					
观点总结	周三I2401合约小幅反弹, 进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石发运量及到港口量均出现下滑, 将减少铁矿石现货供应。贸易商报盘积极性一般, 报价坚挺; 钢厂方面询盘少, 按需补库为主。当前成材需求较弱, 且铁矿及焦炭价格处在相对高位, 导致钢厂利润情况整体欠佳, 钢厂向上挤压炉料意愿依存。技术上, I2401合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上建议, 反弹择机短空, 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!

 研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444
 助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823
 王世霖 期货从业资格号F03118150

备注: I: 铁矿石

 期货投资咨询从业证书号Z0013101
 王凯慧 期货从业资格号F03100511

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。

