

| 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)  | 873.50    | +11.00↑   | 主力合约持仓量(手)           | 784,092  | +28528↑  |
|      | 1-5合约价差(元/吨)  | 43        | +3.50↑    | 合约前20名净持仓(手)         | 73270    | +9316↑   |
|      | 大商所仓单(手)  | 2,200.00  | -2900.00↓ |                      |          |          |
|      | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)   | 121.75    | +1.57↑    |                      |          |          |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)  | 1,005     | +4↑       | 天津港61%麦克粉矿(元/干吨)     | 991      | +5↑      |
|      | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)  | 899       | -5↓       | 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)   | 118      | -6↓      |
|      | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨)  | 122.75    | -1.70↓    | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)  | 3.25     | -0.06↓   |
|      | 进口成本预估值(元/吨)  | 1,025     | -14↓      |                      |          |          |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)   | 2,598.20  | +79.00↑   | 中国47港到港总量(周, 万吨)     | 2,340.60 | -492.00↓ |
|      | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)  | 11,865.75 | -2.12↓    | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)    | 8,832.48 | +300.59↑ |
|      | 铁矿石进口量(月, 万吨)   | 10,642.00 | +1294.00↑ | 铁矿石可用天数(周, 天)        | 18.00    | +1.00↑   |
|      | 全国186座矿山开工率(旬, %)   | 65.42     | +0.45↑    | 全国186座矿山库存量(旬, 万吨)   | 104.39   | -6.91↓   |
| 下游情况 | BDI指数   | 1,526.00  | +87.00↑   | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 9.32     | +0.38↑   |
|      | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)  | 21.23     | +0.57↑    |                      |          |          |
|      | 247家钢厂高炉开工率(周, %)   | 84.07     | -0.32↓    | 247家钢厂高炉产能利用率(周, %)  | 92.65    | -0.11↓   |
| 期权市场 | 国内粗钢产量(月, 万吨)   | 8,641     | -439↓     |                      |          |          |
|      | 标的历历史20日波动率(日, %)   | 22.52     | -0.09↓    | 标的历历史40日波动率(日, %)    | 41.81    | +0.03↑   |
| 行业消息 | 平值看涨期权隐含波动率(日, %)   | 30.78     | +0.14↑    | 平值看跌期权隐含波动率(日, %)    | 30.70    | +0.55↑   |
|      | 1、9月11日-9月17日中国47港到港总量2340.6万吨, 环比减少492.0万吨; 中国45港到港总量2200万吨, 环比减少502.8万吨; 北方六港到港总量为987.1万吨, 环比减少255.4万吨。<br>2、经合组织表示, 将2023年全球经济增长预测上调至3.0% (之前为2.7%), 将2024年预测下调至2.7% (之前为2.9%)。                    |           |           |                      |          |          |
| 观点总结 | 周三I2401合约震荡偏强, 进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石发运量小幅增加, 但到港量明显下滑, 将降低现货供应。贸易商报盘较为积极, 报价坚挺, 而钢厂方面询货积极性尚可。近期国内房地产利好政策频发, 对矿价构成支撑, 只是钢厂利润微薄亦将抑制矿价上行空间。技术上, I2401合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴上方。操作上建议, 维持日内短线交易, 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。

