瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

铁矿石产业链日报

2024/12/9

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）	808.50	+11.00↑	I 主力合约持仓量(手)	235,466	-15924↓
	I 1-5合约价差（元/吨）	17	-2.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	5536	+944↑
	I 大商所仓单（手）	2,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15：00报价(美元/吨)	103.85	+0.10↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	855	+10↑	青岛港60.8%麦克粉矿 (元/干吨)	834	+11↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	736	+11↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	25	-0↓
	铁矿石62%普氏指数（美元/吨）	103.40	-0.95↓	铁废价差	19.00	+9.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	870	-7↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周，万吨)	2,146.90	-387.50↓	中国47港到港总量(周，万吨)	2,632.90	+164.40↑
	45港铁矿石港口库存量(周，万吨)	15,032.14	-18.71↓	样本钢厂铁矿石库存量(周，万吨)	9,372.15	+86.60↑
	铁矿石进口量(月，万吨)	10,384.00	-29.00↓	45港口日均疏港量(周，万吨)	323.46	-12.48↓
	全国186座矿山日产量(旬，万吨)	40.84	-0.39↓	全国186座矿山开工率(旬，%)	64.51	-0.81↓
	全国186座矿山库存(旬，万吨)	39.10	-1.95↓	BDI指数	1,237.00	+7.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.93	-0.03↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.275	+0.04↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周，%)	81.45	-0.15↓	247家钢厂高炉产能用率(周，%)	87.31	-0.47↓
	国内粗钢产量(月，万吨)	8,188	+481↑	日均铁水产量(247家)(周，万吨)	232.55	-1.19↓
期权市场	标的历史20日波动率(日，%)	21.59	-0.85↓	标的历史40日波动率(日，%)	26.28	-0.03↓
	平值看涨期权隐含波动率(日，%)	27.03	+1.16↑	平值看跌期权隐含波动率(日，%)	26.25	+0.01↑

行业消息

1.半岛电视台：短短十天，叙利亚反对派武装突然发起的大规模军事行动迅速攻城略地，局势变化之快，震惊世界。仅大约一周时间，反对派武装及极端组织先后攻下叙利亚北部重镇阿勒颇、第四大城市哈马。叙利亚反对派武装对媒体发表声明称，他们已占领首都大马士革，并宣布“阿萨德政权结束”，叙利亚已经翻开了“历史的新篇章”。目前叙利亚总理贾拉利正在大马士革一家酒店与反政府武装进行权力交接，叙利亚总统阿萨德已放弃总统职位。

2.路透综合逾20家机构预估中值显示，中国物价依然偏弱。食品价格明显回落，但基数效应影响下11月居民消费价格指数(CPI)同比料微升至0.5%；...当月工业生产者出厂价格指数(PPI)同比跌幅则预计略收窄至2.8%

更多资讯请关注！

观点总结

12月9日，铁矿2501合约收盘808.5，上涨1.57%。宏观面，叙利亚反对派武装占领首都大马士革，该国总统巴沙尔·阿萨德逃往俄罗斯，美国当选总统特朗普表示，俄罗斯放弃巴沙尔导致其倒台。基本面，供应维持宽松，本期铁水产量232.61万吨，环比降1.26万吨，年同比增加3.31万吨，需求端面临季节性回落压力。驱动方面，铁矿跟随成材波动为主，成材冬储价市场预期目前在3100-3300元/吨。技术上方面，4小时周期K线位于20和60均线上方，操作上，震荡对待，请投资者注意风险控制。

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
徐玉花 期货从业资格号F03132080 期货投资咨询从业证书号Z0021386
助理研究员：李秋荣 期货从业资格号F03101823

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。