瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

铁矿石产业链日报

2024/2/21

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）	893.00	-16.50↓	I 主力合约持仓量(手)	523,416	+11510↑
	I 5-9合约价差（元/吨）	64	-0.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	64240	-1270↓
	I 大商所仓单（手）	2,300.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	119.35	-1.48↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	1,001	-47↓	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	984	-53↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	894	-37↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	91	-37↓
	铁矿石62%普氏指数（美元/吨）	128.80	-1.20↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.25	+0.10↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,064	-10↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周，万吨)	2,476.20	+419.80↑	中国47港到港总量(周，万吨)	2,577.40	-118.10↓
	45港铁矿石港口库存量(周，万吨)	13,145.12	+196.06↑	样本钢厂铁矿石库存量(周，万吨)	9,568.47	-1343.66↓
	铁矿石进口量(月，万吨)	10,086.00	-188.00↓	铁矿石可用天数(周，天)	30.00	+2↑
	全国186座矿山开工率(旬，%)	63.88	-0.28↓	全国186座矿山日产量(旬，万吨)	49.88	-0.22↓
	BDI指数	1,632.00	+3.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.05	-0.23↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.52	-0.34↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周，%)	76.35	-0.43↓	247家钢厂高炉产能用率(周，%)	83.99	+0.17↑
	国内粗钢产量(月，万吨)	6,744	-866↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日，%)	27.86	+0.50↑	标的历史40日波动率(日，%)	27.34	+0.31↑
	平值看涨期权隐含波动率(日，%)	34.08	+3.14↑	平值看跌期权隐含波动率(日，%)	32.71	+2.83↑

行业消息

1、2月12日-2月18日中国47港到港总量2577.4万吨，环比减少118.1万吨；中国45港到港总量2528.5万吨，环比减少1.2万吨；北方六港到港总量为1379.5万吨，环比增加156.9万吨。

2、2月12日-2月18日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2476.2万吨，环比增加419.8万吨。澳洲发运量1725.7万吨，环比增加243.4万吨，其中澳洲发往中国的量1561.5万吨，环比增加268.8万吨。巴西发运量750.4万吨，环比增加176.4万吨。

更多资讯请关注！

观点总结

周三I2405合约反弹受阻，进口铁矿石现货报价继续下调。本期澳巴铁矿石发运量明显增加，而到港量减少，铁矿石现货供应相对宽松。盘中随着煤焦及钢材期价走高，铁矿石期价亦出现反弹，只是目前港口铁矿石各品种贸易资源较为充足，钢厂采购以按需补库为主，因行情波动较大，多持观望态度，采购较为谨慎。技术上，I2405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

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
助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823 王凯慧 期货从业资格号F03100511
王世霖 期货从业资格号F03118150

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。