

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)	778.50	-15.50↓	主力合约持仓量(手)	469,596	-18419↓
	5-9合约价差(元/吨)	41.5	-3.50↓	合约前20名净持仓(手)	-35431	-15983↓
	大商所仓单(手)	3,200.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	101.95	-2.03↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	850	-11↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	828	-11↓
	京唐港56.5%超特粉矿(元/干吨)	701	-5↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	50	+5↑
	铁矿石62%普氏指数(前一日,美元/吨)	105.05	+1.55↑	江苏废钢/青岛港60.8%麦克粉矿	3.35	+0.02↑
	进口成本预估值(元/吨)	881	+12↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨)	2,353.70	-288.80↓	中国47港到港总量(周,万吨)	2,995.00	+1089.80↑
	45港铁矿石库存量(周,万吨)	14,420.85	-157.03↓	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,144.65	-37.76↓
	铁矿石进口量(月,万吨)	11,249.00	+1063.00↑	铁矿石可用天数(周,天)	19.00	0.00
	266座矿山日产量(周,万吨)	41.01	+0.42↑	266座矿山开工率(周,%)	64.68	+0.42↑
	266座矿山铁精粉库存(周,万吨)	57.25	+12.91↑	BDI指数	1,669.00	+19.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.81	+0.16↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.24	-0.25↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	80.60	+1.07↑	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	86.59	+0.03↑
	国内粗钢产量(月,万吨)	7,597	-243↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	20.29	+1.08↑	标的历史40日波动率(日,%)	20.41	+0.67↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	18.82	-1.05↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	14.49	-8.16↓
行业消息	1、2025年03月10日-03月16日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2353.7万吨,环比减少288.8万吨。澳洲发运量1873.2万吨,环比增加47.0万吨,其中澳洲发往中国的量1538.4万吨,环比增加51.0万吨。巴西发运量480.5万吨,环比减少335.8万吨。 2、2025年03月10日-03月16日中国47港到港总量2995.0万吨,环比增加1089.8万吨;中国45港到港总量2876.4万吨,环比增加1037.8万吨;北方六港到港总量1431.4万吨,环比增加465.5万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2505合约减仓下挫。宏观面,国家发改委表示,促消费文件首提稳股市、稳楼市,努力让老百姓消费底气更足。供需情况,本期澳巴铁矿石发运量减少,到港量大幅提升,弱化港口库存下滑的利好;钢厂高炉复产增多,铁水产量提升。商品市场氛围整体偏弱,铁矿持仓减多增空。技术上,I2505合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上,日内短线交易,注意操作节奏及风险控制。					
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

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。