

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)	761.00	+25.00↑	I主力合约持仓量(手)	404,902	-35808↓
	I1-5合约价差(元/吨)	9	+3.00↑	I合约前20名净持仓(手)	-38880	+8838↑
	I大商所仓单(手)	1,400.00	-200.00↓			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	99.5	+0.50↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	804	-4↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	783	-3↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	685	-2↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	22	-28↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	96.80	-1.90↓	铁废价差	76.00	+57.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	817	-16↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	2,558.80	-85.30↓	中国47港到港总量(周,万吨)	2,905.90	+415.70↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	15,276.12	+3.64↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,053.73	-76.78↓
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,384.00	-29.00↓	铁矿石可用天数(周,天)	22.00	+5↑
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	41.83	+0.72↑	全国186座矿山开工率(旬,%)	66.22	+0.88↑
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	40.50	+1.94↑	BDI指数	1,634.00	+93.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.54	+0.99↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.275	+1.18↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	82.06	-0.21↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	88.60	+0.75↑
	国内粗钢产量(月,万吨)	8,188	+481↑	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	236.00	+2.01↑
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	28.00	+2.52↑	标的历史40日波动率(日,%)	42.82	+0.55↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	29.69	-1.51↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	30.70	+0.86↑
行业消息	1.国家统计局:随着存量政策加快落实和一揽子增量政策加力推出,市场信心得到提振,主要体现在股市、楼市交易活跃,企业和消费者的预期改善上。从房地产市场来看,新房销售改善、二手房交易明显增加、市场活跃度提升。数据显示,1-10月全国新建商品房销售面积、销售额累计降幅比1-9月分别收窄1.3和1.8个百分点。 2.海关总署11月18日数据显示,2024年10月中国出口汽车58万辆,同比增长11.1%;1-10月累计出口528万辆,同比增长24.8%。					 更多资讯请关注!
观点总结	11月18日,铁矿2501合约收盘761,上涨1.87%,午后青岛港PB粉下调4元/吨。宏观面,特朗普交易推升美元,利空大宗商品。基本面,供应维持宽松,本期铁水产量235.94万吨,环比增1.88万吨,年同比增加0.47万吨,需求端仍面临季节性回落压力。驱动方面,市场交易逐渐转向冬储逻辑,铁矿跟随成材波动为主,成材冬储价市场预期目前在3100-3200元/吨。技术上方面,4小时周期K线位于20和60均线下方,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。