

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)	693.00	-69.50↓	I 主力合约持仓量(手)	494,215	+248430↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	45.5	+3.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	-30963	-20228↓
	I 大商所仓单 (手)	3,300.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15: 00报价(美元/吨)	94.65	-3.10↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	839	+51↑	青岛港60.8%麦克粉矿 (元/干吨)	818	+41↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	687	+51↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	125	+74↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	98.85	-2.95↓	铁废价差	53.00	-18.00↓
	进口成本预估值(元/吨)	835	-23↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周, 万吨)	2,393.00	-254.80↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,359.10	-13.20↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	15,363.68	+433.42↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,171.72	+61.27↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,421.00	-294.00↓	45港口日均疏港量(周, 万吨)	268.61	-61.60↓
	全国186座矿山日产量(旬, 万吨)	41.12	-0.01↓	全国186座矿山开工率(旬, %)	65.05	-0.22↓
	全国186座矿山库存(旬, 万吨)	64.13	+8.35↑	BDI指数	1,650.00	-88.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.12	-1.15↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.805	-0.85↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.15	+1.02↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.66	+0.56↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,597	-243↓	日均铁水产量(247家)(周, 万吨)	238.79	+1.03↑
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	41.54	+17.07↑	标的历史40日波动率(日, %)	32.49	+9.67↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	27.36	+1.91↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	26.73	-0.35↓
行业消息	1.欧盟准备动用“一切贸易防御手段” 应对美关税冲击, 将于4月15日起实施第一轮对美反制关税。 2.中央汇金、中国诚通、中国国新7日发布公告称出手增持中国股票资产, 坚决维护资本市场平稳运行, 并表示坚决当好长期资本、耐心资本、战略资本。				 更多资讯请关注!	
观点总结	4月8日, 铁矿I2509合约大幅下跌, 主力换月, 远期估值预期下降驱动行情进一步下行。宏观面, 中美贸易紧张局势导致经济衰退的可能性增加, 工业品创2020年12月以来新低。供需方面, 供应预期宽松, 铁水产量环比延续增加, 但是高度有限, 总的来看, 关税问题将继续影响市场和投资者情绪。技术方面, 4小时周期K线位于20和60均线下方, 操作上, 震荡偏弱运行对待, 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

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。