



| 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) | 892.00 | +3.00↑ | I主力合约持仓量(手) | 516,375 | -6173↓ |
| | I5-9合约价差(元/吨) | 69 | +2.00↑ | I合约前20名净持仓(手) | 52550 | +2067↑ |
| | 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) | 114.9 | +0.23↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 964 | -20↓ | 天津港61%麦克粉矿(元/干吨) | 947 | -27↓ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 862 | -11↓ | I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 55 | -30↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 116.90 | -1.30↓ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.39 | +0.04↑ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 968 | -11↓ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨) | 2,078.50 | -397.70↓ | 中国47港到港总量(周,万吨) | 2,118.80 | -458.50↓ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周,万吨) | 13,607.26 | +462.14↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨) | 9,530.96 | -37.51↓ |
| | 铁矿石进口量(月,万吨) | 10,086.00 | -188.00↓ | 铁矿石可用天数(周,天) | 22.00 | 0.00 |
| | 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 | 2,041.00 | +142.00↑ | | | |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 26.80 | +0.54↑ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 11.55 | +0.56↑ |
| | 247家钢厂高炉开工率(周,%) | 75.61 | -0.74↓ | 247家钢厂高炉产能利用率(周,%) | 83.57 | -0.42↓ |
| | 国内粗钢产量(月,万吨) | 6,744 | -866↓ | | | |
| 期权市场 | I标的历史20日波动率(日,%) | 27.75 | -0.64↓ | I标的历史40日波动率(日,%) | 27.05 | -0.25↓ |
| | I平值看涨期权隐含波动率(日,%) | 29.60 | -0.20↓ | I平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 29.61 | +0.60↑ |
| 行业消息 | 1、Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2479.03万吨,环比上期降149.28万吨。烧结粉总日耗105.84万吨,降0.89万吨。库存消费比23.42,降1.2。 2、2月下旬,伊朗宣布再次调整其炼钢行业相关的出口关税政策,其中铁矿石球团及精粉的出口关税由此前的20%分别大幅下调至2%和5%。 | | | | |  更多资讯请关注! |
| 观点总结 | 周四I2405合约减仓整理,进口铁矿石现货报价下调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量明显减少,但当前港口各品种贸易资源较为充足。贸易商出货积极性尚可,报价多随行就市。需求方面,钢厂采购以按需补库为主,采购较为谨慎。多空因素交织,短线行情仍有反复,注意操作节奏。技术上,I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位反弹。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!

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

备注: I: 铁矿石

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。