

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)	762.00	-0.50↓	主力合约持仓量(手)	497,918	-9039↓
	5-9合约价差(元/吨)	17	-0.50↓	合约前20名净持仓(手)	-24481	-2098↓
	大商所仓单(手)	2,900.00	0.00			
现货市场	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	99.6	-0.35↓			
	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	821	-2↓	青岛港60.5%麦克粉矿(元/干吨)	808	-1↓
	京唐港56.5%超特粉矿(元/干吨)	723	0.00	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	46	-1↓
	铁矿石62%普氏指数(前一日, 美元/吨)	99.95	-0.25↓	江苏废钢/青岛港60.5%麦克粉矿	3.25	+0.02↑
产业情况	进口成本预估值(元/吨)	799	-2↓			
	全球铁矿石发运总量(周, 万吨)	2,535.30	-559.30↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,455.60	-213.60↓
	47港铁矿石库存量(周, 万吨)	17,914.68	+156.42↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,316.64	+348.05↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	11,965.00	+911.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	32.00	+3↑
	266座矿山日产量(周, 万吨)	38.51	-1.05↓	266座矿山开工率(周, %)	61.27	-1.67↓
下游情况	266座矿山铁精粉库存(周, 万吨)	39.07	-2.71↓	BDI指数	1,958.00	+76.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.86	+0.51↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.417	+0.47↑
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	79.55	+0.53↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	85.71	+0.26↑
期权市场	国内粗钢产量(月, 万吨)	6,818	-169↓			
	标的历历史20日波动率(日, %)	15.09	-0.13↓	标的历历史40日波动率(日, %)	16.60	-0.20↓
行业消息	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	21.36	+1.68↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	17.09	-1.03↓
	1、Mysteel统计54家钢厂烧结矿周产量756.70万吨, 环比上期增加7.60万吨, 环比增加1.01%。烧结矿库存277.04万吨, 环比上期减少10.61万吨, 环比减少3.69%。 2、Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存3547.77万吨, 环比上期增84.62万吨。进口烧结粉总日耗112.99万吨, 环比上期减0.89万吨。库存消费比31.4, 环比上期增0.99。					
观点总结	周四I2605合约震荡偏弱。宏观方面, 美国1月季调后非农就业人口增加13万人, 远超市场预期, 降息预期放缓。供需情况, 本期澳巴铁矿石发运量和到港量下滑, 钢厂高炉开工率平稳, 铁水产量维持230万吨下方, 铁矿石港口库存再创新高。整体上, 随着春节期间临近钢厂补库需求减弱, 期价延续区间整理。技术上, I2605合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位反弹, 红柱缩小。观点参考, 短线交易, 注意风险控制。					
	重点关注	周五国内铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率				

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。

