

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)	807.50	-24.00↓	I 主力合约持仓量(手)	490,917	+17611
	I 5-9合约价差 (元/吨)	22	-4.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	12885	-13105↓
	I 大商所仓单 (手)	1,700.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	105.05	-4.18↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	880	-19↓	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	869	-24↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	771	0.00	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	62	-0↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	108.40	-8.25↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.43	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	899	-67↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	3,522.40	-22.10↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,126.40	-398.00↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	14,147.31	+258.74↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,333.19	-197.77↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,086.00	-188.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	20.00	-2↓
	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	2,315.00	-62.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	31.14	-0.21↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	13.4	-1.07↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.62	+0.45↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	83.09	-0.23↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	6,744	-866↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	33.55	+0.99↑	标的历史40日波动率(日, %)	30.07	+0.60↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	33.36	-0.14↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	32.79	+0.48↑
行业消息	1、3月4日-3月10日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2522.4万吨, 环比减少22.1万吨。澳洲发运量1895.6万吨, 环比增加59.5万吨, 其中澳洲发往中国的量1495.6万吨, 环比增加44.8万吨。巴西发运量626.7万吨, 环比减少81.7万吨。 2、唐山、邯郸、衡水、石家庄等地分别定于3月13日18时或22时起启动重污染天气Ⅱ级应急响应, 具体解除时间另行通知。					 更多资讯请关注!
观点总结	周三I2405合约震荡下行, 进口铁矿石现货报价继续下调。由于国内铁矿石港口库存持续增加, 港口各品种贸易资源较为充足, 贸易商报盘积极性一般, 价格随行就市。钢厂方面询盘少, 观望较多, 部分有招标采购计划。近期部分地区钢厂成材库存压力较大, 增加了临时性高炉检修计划, 短期对铁矿石现货构成压力, 铁矿石期价或保持弱势运行。技术上, I2405合约1小时 MACD指标显示DIFF与DEA向下运行。操作上建议, 维持偏空交易, 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

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。