

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)	951.50	-12.00↓	主力合约持仓量(手)	472,144	+22290↑
	5-9合约价差 (元/吨)	67	-2.50↓	合约前20名净持仓(手)	69437	+5697↑
	大商所仓单 (手)	2,300.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	127.4	-3.87↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	1,080	+11↑	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	1,060	+11↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	952	0.00	主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	108	+13↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	130.00	+0.50↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.09	+0.03↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,073	+4↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,476.20	+419.80↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,577.40	-118.10↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,145.12	+196.06↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,568.47	-1343.66↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,086.00	-188.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	30.00	+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	1,610.00	+29.00↑			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	0.00	0.00	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	0	0.00
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	76.35	-0.43↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	83.99	+0.17↑
	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, %)	22.81	-1.88↓	标的历史40日波动率(日, %)	24.59	+0.16↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	29.78	+1.60↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.80	+1.94↑
行业消息	1、2月12日-2月18日中国47港到港总量2577.4万吨, 环比减少118.1万吨; 中国45港到港总量2528.5万吨, 环比减少1.2万吨; 北方六港到港总量为1379.5万吨, 环比增加156.9万吨。 2、2月12日-2月18日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2476.2万吨, 环比增加419.8万吨。澳洲发运量1725.7万吨, 环比增加243.4万吨, 其中澳洲发往中国的量1561.5万吨, 环比增加268.8万吨。巴西发运量750.4万吨, 环比增加176.4万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2405合约高开低走, 进口铁矿石现货报价涨跌互现。本期澳巴铁矿石发运量明显增加, 而到港量减少, 铁矿石现货供应相对宽松。贸易商报价积极性不高, 多随行就市; 钢厂询盘较少, 采购谨慎。钢厂铁水产量并未见明显增加, 部分钢厂库存仍较充足, 采购较少。随着钢价走弱及焦炭报价下调对炉料构成压力。技术上, I2405合约1小时 MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴附近。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。