



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)	831.00	-46.00↓	I主力合约持仓量(手)	495,786	+90241
	I5-9合约价差(元/吨)	36	-5.00↓	合约前20名净持仓(手)	23044	-21941↓
	I大商所仓单(手)	1,900.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	107.4	-7.78↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	907	-39↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	897	-45↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	793	-37↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	66	+11
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	116.65	-2.35↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.48	+0.09↑
	进口成本预估值(元/吨)	965	-19↓			
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	2,345.00	+94.00↑			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	30.41	+1.15↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	14.05	+0.70↑
	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,%)	32.61	+3.90↑	标的历史40日波动率(日,%)	29.45	+2.67↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	32.75	+2.82↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	32.57	+2.25↑
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、3月4日-3月10日中国47港到港总量2126.4万吨,环比减少398.0万吨;中国45港到港总量2024.7万吨,环比减少352.3万吨;北方六港到港总量为984.5万吨,环比减少257.1万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2405合约增仓下行,进口铁矿石现货报价大幅下调。由于国内铁矿石港口库存持续增加,目前港口各品种贸易资源较为充足,贸易商报盘积极性一般,报价多随行就市;钢厂方面询盘少,观望较多,以按需采购为主。近期由于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。技术上,I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下走弱。操作上建议,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!

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
 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。