

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)	828.50	+16.50↑	I主力合约持仓量(手)	575,614	+23910↑
	I5-9合约价差(元/吨)	43.5	+2.00↑	合约前20名净持仓(手)	38648	+6813↑
	I大商所仓单(手)	2,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	107.95	+2.25↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	875	-9↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	848	-7↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	727	-1↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	19	-23↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	106.55	-1.15↓	铁废价差	150.00	-11.00↓
	进口成本预估值(元/吨)	893	-9↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	2,770.40	-872.30↓	中国47港到港总量(周,万吨)	1,852.60	+69.70↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	15,363.68	+433.42↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,464.74	-1381.58↓
	铁矿石进口量(月,万吨)	11,249.00	+1063.00↑	45港口日均疏港量(周,万吨)	268.61	-61.60↓
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	36.39	-3.32↓	全国186座矿山开工率(旬,%)	58.25	-4.64↓
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	41.86	+5.34↑	BDI指数	753.00	-8.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.92	-0.09↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.375	-0.09↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	78.00	0.00	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	85.78	+1.12↑
	国内粗钢产量(月,万吨)	7,597	-243↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	228.44	+2.98↑
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	17.32	+0.79↑	标的历史40日波动率(日,%)	19.92	+0.34↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	24.66	-0.26↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	24.04	-0.45↓
行业消息	<p>1.富达投资:已增加中国股票持仓,并给予超配,中国市场的“动物精神”正在回归。除了经济基本面和动物精神外,令人兴奋的新人工智能工具也带来机会。市场可能会从这里反弹,但“不会是一条直线”。</p> <p>2.2月10日,中国47港进口铁矿石库存总量15846.54万吨,较上一周增加118.25万吨;45港库存总量15216.54万吨,环比增加157.55万吨。</p>					<p>更多资讯请关注!</p>
观点总结	<p>2月12日,铁矿2505合约收盘828.5,上涨0.91%。宏观面,欧盟领导人11日表示,将采取强硬的反制措施应对美国对所有进口钢铁和铝征收关税的决定。基本面,本期发运受到澳洲飓风影响,供应回落,需求端本期铁水产量228.44万吨,环比增加2.99万吨,年同比增加4.35万吨,一季度发运预计偏淡,继续关注发运及港存去化情况。驱动方面,钢材终端需求尚未恢复,铁矿自身难持续走出独立行情。技术方面,4小时周期K线位于20和60均线上方,操作上,震荡运行对待,请投资者注意风险控制。</p>					
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

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。