



撰写人：许方莉 从业资格证号：F3073708 投资咨询从业证书号：Z0017638

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)	894.00	+4.50↑	I 主力合约持仓量(手)	945,814	+9230↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	54	+1.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	93546	+1303↑
	I 大商所仓单 (手)	4,000.00	-1400.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	128.45	+1.91↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	967	+2↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	951	+4↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	847	+4↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	57	-0↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	127.30	+2.55↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.43	-0.02↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,022	+20↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,303.20	+452.30↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,159.50	-766.60↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	14,110.72	+100.44↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,237.10	-35.65↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,086.00	-799.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	18.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	55.63	+3.67↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	208.02	-6.45↓
	BDI指数	538.00	+8.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.11	-0.06↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.062	-0.01↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	79.54	+1.12↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	85.75	+0.82↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,789	+335↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	21.72	-8.66↓	标的历史40日波动率(日, %)	29.47	-0.17↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	28.52	+2.41↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	28.50	+2.41↑
行业消息	1、大商所发布市场风险提示公告称，近期，影响市场运行的不确定性因素较多，铁矿石等品种价格波动较大。请各市场主体理性合规参与，防控风险，确保市场平稳运行。 2、2月13日-2月19日 中国47港到港总量2159.5万吨，环比减少766.6万吨；中国45港到港总量2061.1万吨，环比减少794.1万吨；北方六港到港总量为1048.8万吨，环比减少310.2万吨。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周一I2305合约低开高走，进口铁矿石现货报价上调。贸易商报盘积极性一般，部分有投机操作，钢厂维持按需采购，由于钢厂高炉开工率持续回升，铁矿石现货需求增加预期较强，支撑矿价持续走高。短期关注监管部门对铁矿石价格指导的影响。技术上，I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA高位运行。操作上建议，震荡偏多交易，注意风险控制。					 <div>更多观点请咨询！</div>
重点关注						