

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)	908.50	-1.00↓	I 主力合约持仓量(手)	901,515	-25935↓
	I 5-9合约价差(元/吨)	55	-8.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	77966	-386↓
	I 大商所仓单(手)	3,900.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	129.75	-0.26↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	992	+3↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	982	+4↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	874	+15↑	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	73	+5↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	130.60	-1.25↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.33	-0.01↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,054	-6↓			
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)	17.00	-1.00↓
	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	674.00	+80.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	6.295	+0.17↑
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.30	+0.23↑			
	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, %)	23.70	-0.28↓	标的历史40日波动率(日, %)	27.90	-0.94↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	27.83	-1.07↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	27.21	-1.45↓
行业消息	1、据中钢协数据显示，2023年2月中旬，重点钢企粗钢日均产量209.28万吨，环比增长1.49%；钢材库存量1953.0万吨，比上一旬增加150.05万吨，增长8.32%。 2、23日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2479.74万吨，环比上期降105.8万吨。烧结粉总日耗110.87万吨，降0.39万吨。					
观点总结	周四I2305合约减仓整理，进口铁矿石现货报价小幅上调。大商所调整铁矿石期货交易限额仍影响着市场情绪，贸易商报价积极性尚可，出货多随行就市，但贸易商报价较为坚挺，钢厂方面仅个别有采货计划，询盘一般。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，对矿价仍有支撑。技术上，I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA高位回调。操作上建议，日内短线交易，注意风险控制。					
重点关注	周五铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率					

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



更多资讯请关注！



更多观点请咨询！