

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)	926.50	+6.50↑	I 主力合约持仓量(手)	855,000	+9193↑
	I 5-9合约价差(元/吨)	58	-0.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	113942	+4304↑
	I 大商所仓单(手)	1,900.00	-600.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	132.35	+0.63↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	995	-5↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	986	-3↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	869	-3↓	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	60	-10↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	133.00	+0.65↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.31	-0.01↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,067	+1↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,428.80	-32.50↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,225.50	-44.20↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,770.03	-230.53↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,257.73	+4.17↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,086.00	-799.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	19.00	+1.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	56.89	-0.50↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	181.15	-9.54↓
下游情况	BDI指数	1,587.00	+122.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	9.175	+0.68↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	21.42	+1.27↑			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.00	+0.93↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	88.03	+0.88↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,789	+335↑			
行业消息	标的历史20日波动率(日, %)	22.30	-0.11↓	标的历史40日波动率(日, %)	27.02	-0.04↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	27.55	-0.87↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	28.44	+0.22↑
观点总结	1、国家统计局数据显示: 2023年1-2月生铁日均产量244.51万吨; 1-2月中国生铁产量14426万吨, 同比增长7.3%。 2、Mysteel卫星数据显示, 2023年3月6日-3月12日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1066.8万吨, 周环比下降59.7万吨, 略低于今年以来的均值。					
	周三I2305合约高位整理, 进口铁矿石现货报价下调。本期铁矿石港口库存继续下滑, 由于钢厂高炉开工率持续回升, 增加铁矿石现货需求。贸易商报盘积极性尚可, 另外部分贸易商由于成本原因, 低价出货意愿较差, 但随着黑色系普遍回落将拖累铁矿石期价。技术上, I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议, 反弹择机短空, 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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!