

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)	863.00	+15.00↑	I 主力合约持仓量(手)	883,705	+33897↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	39	+1.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	79499	+14507↑
	I 大商所仓单 (手)	4,200.00	-200.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	123.95	+2.58↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	942	+12↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	923	+11↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	816	+9↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	60	-4↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	122.90	+1.20↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.54	-0.02↓
	进口成本预估值(元/吨)	978	+11↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,454.90	+296.60↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,519.40	-9.20↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,911.29	+185.46↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,220.27	-8.02↓
	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	-1.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	51.96	-3.84↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	214.47	+0.85↑
	BDI指数	603.00	+2.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.57	+0.15↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.27	+0.01↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	77.41	+0.72↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	84.32	+0.17↑
	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, %)	33.85	+0.41↑	标的历史40日波动率(日, %)	30.92	-0.26↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.69	-0.85↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	30.24	-1.43↓
行业消息	1、9日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2572.14万吨, 环比上期降30.94万吨。烧结粉总日耗112.35万吨, 增1.53万吨。 2、根据Mysteel卫星数据显示, 2023年1月30日-2月5日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1116.6万吨, 周环比下降115.5万吨, 处于近半年平均水平。					 更多资讯请关注!
观点总结	周四I2305合约增仓上行, 进口铁矿石现货报价上调。随着国际油价反弹带动大宗商品价格走高, 另外钢厂高炉开工率继续回升, 提升铁矿石现货需求预期, 同时厂内库存可用天数继续下滑提振矿价上行。技术上, I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA延续反弹。操作上建议, 震荡偏多交易, 注意风险控制。					 更多观点请咨询!
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