

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)	841.50	-22.00↓	I 主力合约持仓量(手)	852,473	-19451↓
	I 5-9合约价差(元/吨)	46	+6.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	71915	-10282↓
	I 大商所仓单(手)	5,100.00	+1000.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	120.65	-4.07↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	940	-11↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	918	-11↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	809	-11↓	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	77	+11↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	126.10	+0.60↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.56	+0.04↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,006	+8↑			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	1,850.90	-604.00↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,926.10	+406.80↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	14,010.28	+98.99↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,272.75	+52.48↑
	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, %)	55.63	+3.67↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	208.02	-6.45↓
下游情况	BDI指数	602.00	+10.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	6.2	+0.18↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.68	+0.07↑			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	78.42	+1.01↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	84.93	+0.61↑
	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, %)	31.66	-1.64↓	标的历史40日波动率(日, %)	29.90	-0.10↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	31.59	+6.52↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	30.81	+5.42↑
观点总结	1、2月6日-2月12日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量1850.9万吨，环比减少604.0万吨。澳洲发运量1272.8万吨，环比减少662.0万吨，其中澳洲发往中国的量1141.2万吨，环比减少452.8万吨。巴西发运量578.1万吨，环比增加58.0万吨。 2、2月6日-2月12日中国47港到港总量2926.1万吨，环比增加406.8万吨；中国45港到港总量2855.1万吨，环比增加490.0万吨；北方六港到港总量为1359.0万吨，环比增加260.7万吨。					
	周一I2305合约减仓下行，进口铁矿石现货报价下调。港口库存继续增加，现货供应维持宽松，但贸易商成本偏高，低价出货意愿不强，部分有挺价操作。而钢厂利润收缩，采购相对谨慎，多以刚需为主。短线行情或陷入区间宽幅波动。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，日内短线交易，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！