



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) | 852.50 | +11.00↑ | I 主力合约持仓量(手) | 806,325 | -27055↓ |
| | I 5-9合约价差 (元/吨) | 26 | 0.00 | I 合约前20名净持仓(手) | 58487 | -2281↓ |
| | I 大商所仓单 (手) | 5,400.00 | -100.00↓ | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨) | 123.8 | +2.11↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨) | 929 | +11↑ | 青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨) | 907 | +8↑ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨) | 790 | +2↑ | I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约) | 54 | -3↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数 (美元/吨) | 122.70 | +1.20↑ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.50 | -0.03↓ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 973 | +10↑ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,193.80 | -73.60↓ | 中国45港到港总量(周, 万吨) | 2,476.90 | -109.70↓ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 13,358.93 | +228.39↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 10,241.19 | +39.49↑ |
| | 铁矿石进口量(月, 万吨) | 9,086.00 | -799.00↓ | 铁矿石可用天数(周, 天) | 27.00 | 0.00 |
| | 全国126座矿山开工率(旬, %) | 55.80 | -0.25↓ | 全国126座矿山库存量(旬, 万吨) | 213.62 | -14.50↓ |
| | BDI指数 | 874.00 | -47.00↓ | | | |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 17.77 | -0.16↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 6.895 | -0.30↓ |
| 下游情况 | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 75.68 | +1.04↑ | 247家钢厂高炉产能利用率(周, %) | 82.56 | +0.63↑ |
| | 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, %) | 33.45 | -0.01↓ | 标的历史40日波动率(日, %) | 32.66 | +0.85↑ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 32.28 | -0.27↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 32.26 | -1.28↓ |
| 行业消息 | 1、Mysteel统计全国45个港口进口铁矿库存为13201.72，环比降157.21；日均疏港量324.56降2.92。分量方面，澳矿6094.43降82，巴西矿4750.21降12.47；贸易矿7836.90降115.08，球团598.31增24.53，精粉1061.28降8.16，块矿2003.66增11.74，粗粉9538.47降185.32；在港船舶数120条，较上周持稳。（单位：万吨） 2、Mysteel调研247家钢厂高炉开工率75.97%，环比上周增加0.29%，同比去年下降0.28%；高炉炼铁产能利用率83.10%，环比增加0.54%，同比增加2.02%；钢厂盈利率27.27%，环比增加4.33%，同比下降54.55%；日均铁水产量223.74万吨，环比增加1.44万吨，同比增加5.54万吨。 | | | | |  更多资讯请关注！ |
| 观点总结 | 周四I2305合约震荡偏强，进口铁矿石现货报价上调。随着春节假期临近，多数钢厂节前补库基本结束，现货市场交投氛围较差，但贸易商仍看好后市，整体上挺价情绪较浓。技术上，I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上反弹。操作上建议，日内短线交易，注意风险控制。 | | | | |  更多观点请咨询！ |
| 重点关注 | | | | | | |