


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)	897.00	-22.00↓	I 主力合约持仓量(手)	826,511	-48457↓
	I 5-9合约价差 (元/吨)	51.5	-8.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	60088	+615↑
	I 大商所仓单 (手)	2,800.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	124.4	-0.99↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	979	-21↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	967	-21↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	864	-15↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	70	+1↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	127.45	+0.20↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.40	+0.09↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,028	-1↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,392.90	+89.60↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	1,916.20	-243.30↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	14,000.56	-222.70↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,253.56	+115.84↑
	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, %)	57.39	+1.76↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	190.69	-17.33↓
	BDI指数	1,211.00	+66.00↑			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.75	+0.63↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.75	+0.38↑
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	81.07	+0.09↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	87.15	+0.18↑
	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, %)	25.01	+2.02↑	标的历史40日波动率(日, %)	29.13	+0.31↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	27.83	-0.11↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	26.84	-1.10↓
行业消息	1、据中钢协数据显示，2023年2月下旬，重点钢企粗钢日均产量222.02万吨，环比增长6.09%；钢材库存量1741.99万吨，比上一旬减少211.01万吨，下降10.80%。 2、针对近一段时间铁矿石价格过快上涨情况，近日国家发展改革委价格监测中心组织部分市场机构和业内专家召开会议，分析研判铁矿石市场和价格形势，提出政策建议。					 更多资讯请关注！
观点总结	周一I2305合约减仓回调，进口铁矿石现货报价下调。本期铁矿石港口库存由增转降，且低于去年同期1853.96万吨；需求端，钢厂高炉开工率及产能利用率继续回升，日均铁水产量延续上行。但国家发展改革委价格监测中心组织部分市场机构和业内专家召开会议，建议加强铁矿石调控监管遏制价格不合理上涨。市场情绪受挫，期价回落。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。					 更多观点请咨询！
重点关注						