

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)	865.50	+9.00↑	I 主力合约持仓量(手)	892,950	+35555↑
	I 5-9合约价差(元/吨)	51	+3.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	80782	+5855↑
	I 大商所仓单(手)	5,400.00	-700.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	123.45	+1.00↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	953	+18↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	936	+22↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	822	+4↑	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	70	+13↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	123.75	+1.90↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.46	-0.08↓
	进口成本预估值(元/吨)	988	+15↑			
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↓
	BDI指数	563.00	-53.00↓	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	6.305	-0.02↓
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.43	-0.25↓			
	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↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	31.53	+0.03↑	标的历史40日波动率(日, %)	29.96	+0.04↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	36.20	+5.90↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.25	+0.31↑
行业消息	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、根据Mysteel卫星数据显示, 2023年2月6日-2月12日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1260.4万吨, 周环比增加143.8万吨, 处于近半年的高位水平。					
观点总结	周三I2305合约增仓上行, 进口铁矿石现货报价上调。港口库存继续增加, 现货供应维持宽松, 但贸易商成本偏高, 报价随行就市, 适价出货为主。钢厂利润偏低, 采购相对谨慎, 多以刚需为主。技术上, I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴上方。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!