

撰写人：陈一兰 从业资格证号：F3010136 投资咨询从业证书号：Z0012698

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	主力合约收盘价(元/吨)	817.50	-11.50↓	主力合约持仓量(手)	841,031	+11897↑
	I 1-5合约价差(元/吨)	14.5	-3.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	74270	+4092↑
	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)	110.9	-1.38↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	898	+21↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	875	+16↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	750	+15↑	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	58	+28↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	114.25	+3.75↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.62	-0.03↓
	进口成本预估值(元/吨)	935	+30↑			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,731.50	+304.80↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,651.60	+141.50↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,398.78	+14.16↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,239.22	+57.53↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,885.00	+387.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	19.00	-2.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	56.79	-0.66↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	232.42	-4.88↓
下游情况	BDI指数	1,723.00	+127.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	9.095	+0.91↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	23.22	+1.03↑			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.97	+0.08↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	82.64	+0.64↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,454	-522↓			
行业消息	标的历史20日波动率(日, %)	32.80	+0.71↑	标的历史40日波动率(日, %)	33.65	-0.78↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	33.95	-0.71↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	34.00	-0.78↓
观点总结	1、国务院常务会议部署深入抓好稳经济一揽子政策措施落地见效，推动经济巩固回稳基础、保持运行在合理区间。会议要求，对落实稳经济一揽子政策措施抓好填平补齐，确保全面落地；推动重大项目建设和设备更新改造形成更多实物工作量，符合冬季施工条件的不得停工。 2、22日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2649.97万吨，环比上期增56.36万吨。烧结粉总日耗106.32万吨，降0.82万吨。	周四I2305合约高开低走，进口铁矿石现货市场报价上调。由于期货盘面回调，贸易商报盘积极性一般，出货情况较差，仅个别有投机需求。当前临近春节补库，贸易商多对后市看好，个别商家低于预期暂不出货。当前钢厂厂内库存多满足常规使用，主要以按需采购为主。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	周五国内铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率					

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！