



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 | I 主力合约收盘价 (元/吨)  | 829.00    | +24.50↑  | I 主力合约持仓量(手)          | 829,134  | +36076↑   |
|      | I 1-5合约价差 (元/吨)  | 18        | -4.50↓   | I 合约前20名净持仓(手)        | 70178    | +6373↑  |
|      | 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)  | 112.55    | +3.24↑   |                       |          |   |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)  | 877       | +8↑      | 青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)     | 859      | +8↑   |
|      | 青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)  | 735       | +7↑      | I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约) | 30       | -17↓  |
|      | 铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)  | 110.50    | +1.30↑   | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)   | 3.65     | -0.06↓  |
|      | 进口成本预估值(元/吨)   | 905       | +8↑      |                       |          |   |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(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↓  |
|      | BDI指数  | 1,596.00  | +48.00↑  |                       |          |   |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)   | 22.19     | +0.79↑   | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)     | 8.185    | +0.09↑  |
|      | 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↓    |                       |          |   |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日, %)   | 32.09     | +1.20↑   | 标的历史40日波动率(日, %)      | 34.43    | +0.35↑  |
|      | 平值看涨期权隐含波动率(日, %)  | 34.66     | +0.03↑   | 平值看跌期权隐含波动率(日, %)     | 34.78    | -0.80↓  |
| 行业消息 | 1、根据Mysteel卫星数据显示, 2022年12月12日-12月18日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1127.5万吨, 周环比增加48.6万吨, 处于今年平均水平。<br>2、12月12日-12月18日中国47港到港总量2651.6万吨, 环比增加141.5万吨; 中国45港到港总量2528.4万吨, 环比增加120.0万吨; 北方六港到港总量为1178.7万吨, 环比增加48.8万吨。 |           |          |                       |          | <br>更多资讯请关注!   |
| 观点总结 | 周三I2305合约增仓上行, 进口铁矿石现货市场报价上调。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向上走高。操作上建议, 震荡偏多交易, 注意风险控制。   |           |          |                       |          | <br>更多观点请咨询! |
| 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