

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)	688.00	+1.00↑	主力合约持仓量(手)	768,358	+9750↑
	I 1-5合约价差(元/吨)	40	+1.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	-36153	+5555↑
	大商所仓单(手)	3,000.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	92	-0.63↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	788	0.00	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	767	0.00
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	689	-7↓	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	79	-1↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	94.80	+1.05↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.21	0.00
	进口成本预估值(元/吨)	797	+9↑			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,471.90	+19.80↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,252.10	-456.30↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,992.70	+30.85↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,396.87	+68.44↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,621.00	+497.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	21.00	+2.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	57.81	-4.75↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	250.00	-0.39↓
	BDI指数	1,875.00	+32.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	9.35	+0.03↑
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.97	+0.03↑			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.62	-0.88↓	247家钢厂高炉产能用率(周, %)	89.04	+0.06↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,387	+244↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	23.45	-0.15↓	标的历史40日波动率(日, %)	33.29	-0.35↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	29.53	-2.64↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	31.36	+0.99↑
行业消息	1、Mysteel统计9月全国332家铁矿山企业铁精粉产量为2209.0, 环比减33.1, 减幅1.5%; 累计同比减344.7, 降幅1.7%; 同期统计, 全国186家矿山企业产能利用率为61.85%, 环比减1.83%。 (单位: 万吨) 2、根据Mysteel卫星数据显示, 2022年10月10日-10月16日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1069.5万吨, 周环比减少45.9万吨, 略低于今年的平均水平。					 更多资讯请关注!
观点总结	周三I2301合约弱势整理, 进口铁矿石现货报价稳中有降。现货市场交投情绪欠佳, 多数钢企处于观望状态。当前, 由于钢厂利润微薄, 生产积极性不佳, 采购需求偏低, 造成买方低价采购意愿高。技术上, I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方, 但重心有所上移。操作上建议, 短线维持在675-700区间低买高抛, 止损8元/吨。					
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