

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)	768.00	+7.00↑	主力合约持仓量(手)	488,996	+9427↑
	1-5合约价差(元/吨)	20.5	-2.00↓	合约前20名净持仓(手)	8171	-7174↓
	大商所仓单(手)	1,400.00	0.00			
现货市场	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	103.55	+1.00↑			
	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	843	+1↑	青岛港60.5%麦克粉矿(元/干吨)	840	+1↑
	京唐港56.5%超特粉矿(元/干吨)	752	+1↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	72	-6↓
	铁矿石62%普氏指数(前一日, 美元/吨)	106.20	+1.00↑	江苏废钢/青岛港60.5%麦克粉矿	3.09	-0.03↓
产业情况	进口成本预估值(元/吨)	862	+8↑			
	全球铁矿石发运总量(周, 万吨)	3,592.50	+224.00↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,928.10	+358.90↑
	47港铁矿石库存量(周, 万吨)	16,111.47	+120.36↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,834.20	-150.53↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	11,054.00	-77.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	21.00	+4↑
	266座矿山日产量(周, 万吨)	37.87	+0.07↑	266座矿山开工率(周, %)	60.07	+0.05↑
下游情况	266座矿山铁精粉库存(周, 万吨)	44.97	+5.41↑	BDI指数	2,204.00	+11.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	25.00	+2.84↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.525	-0.30↓
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	78.61	-1.53↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	85.90	-1.16↓
期权市场	国内粗钢产量(月, 万吨)	6,987	-213↓			
	标的历历史20日波动率(日, %)	12.85	+0.48↑	标的历历史40日波动率(日, %)	15.41	+0.10↑
行业消息	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	15.96	+1.37↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	15.82	-0.93↓
	1、12月15日, 中国47港进口铁矿石港口库存总量16092.66万吨, 较上周增加68.68万吨; 45港库存总量15382.46万吨, 环比增加33.48万吨。					
	2、12月8日-12月14日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1172.0万吨, 环比下降23.6万吨, 呈小幅回落态势。当前库存水平略低于今年四季度以来的平均值。					
观点总结	周三I2605合约增仓上行。宏观方面, 美国劳工统计局公布数据显示, 美国11月非农就业人口增加6.4万人, 高于市场预期的5万人; 但失业率却意外升至4.6%, 创下2021年9月以来的新高。供需情况, 本期澳洲铁矿石发运和到港量同步增加, 随着铁水产量继续下调, 铁矿石港口库存有继续增加预期。整体上, 港口呈累库趋势, 供应相对宽松, 但钢厂原料库存普遍处于中低位, 临近年底冬储, 买盘存在一定预期, 叠加期货贴水现货为期价构成支撑。技术上, I2605合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上反弹。					
	观点参考, 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

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101

免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料, 瑞达期货股份有限公司力求准确可靠, 但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证, 据此投资, 责任自负。本报告不构成个人投资建议, 客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有, 未经书面许可, 任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发, 需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院, 且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。



更多资讯请关注!

