

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)	808.50	0.00	I 主力合约持仓量(手)	762,086	+10228↑
	I 1-5合约价差 (元/吨)	25	-1.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	54936	+3391↑
	I 大商所仓单 (手)	3,600.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	108.4	-0.48↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	880	+5↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	861	+9↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	730	-9↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	52	+9↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	110.30	+0.05↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.67	+0.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	902	-2↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,426.70	-186.50↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,510.20	+125.40↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,384.62	+106.81↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,181.69	+33.56↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,884.60	+386.60↑	铁矿石可用天数(周, 天)	21.00	+2.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	57.45	-0.14↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	237.30	+2.52↑
	BDI指数	1,357.00	-4.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.75	-0.16↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.095	-0.24↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.89	+0.28↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	82.00	-0.62↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,976	-719↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	29.12	-0.46↓	标的历史40日波动率(日, %)	33.54	+0.01↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	36.25	+0.97↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	37.45	+1.16↑
行业消息	1、市场焦点转向美联储定于北京时间周四(12月15日)2点做出的决定。市场普遍预计，美联储将在今年最后一次会议放慢加息脚步至50个基点。 2、根据Mysteel卫星数据显示，2022年12月5日-12月11日期间，澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1078.9万吨，周环比增加56.9万吨，略低于今年平均水平。					 更多资讯请关注！
观点总结	周三I2305合约高位整理，进口铁矿石现货市场报价上调。本期澳巴铁矿石发运量减少，而到港量提升，整体上铁矿石现货供应仍相对宽松。临近年尾，多数贸易商有挺价情绪，低价出货意愿不强。钢厂虽有刚性补库需求但对采购价格谨慎询价较低。继续关注美联储加息决议，对大宗商品的影响。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，震荡偏多交易，注意风险控制。					 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