

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)	830.00	+21.50↑	I 主力合约持仓量(手)	788,881	+26795↑
	I 1-5合约价差 (元/吨)	24	-1.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	58644	+3708↑
	I 大商所仓单 (手)	3,500.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15: 00报价(美元/吨)	111.55	+2.93↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	895	+14↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	874	+13↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	740	+10↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	44	-8↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	109.75	-0.55↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.61	-0.05↓
	进口成本预估值(元/吨)	895	-7↓			
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)	19.00	-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	1,401.00	+44.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.53	+0.78↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.985	-0.11↓
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)	7,454	-522↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	30.09	+0.97↑	标的历史40日波动率(日, %)	32.74	-0.80↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	35.85	-0.40↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	36.69	-0.76↓
行业消息	1、中共中央、国务院印发《扩大内需战略规划纲要（2022-2035年）》指出，必须坚定实施扩大内需战略，不断释放内需潜力，充分发挥内需拉动作用，建设更加强大的国内市场，推动我国经济平稳健康可持续发展。《纲要》提出，展望2035年，实施扩大内需战略的远景目标包括消费和投资规模再上新台阶，完整内需体系全面建立等。 2、15日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2593.61万吨，环比上期降14.58万吨。烧结粉总日耗107.14万吨，增1.71万吨。					 更多资讯请关注！
观点总结	周四I2305合约增仓上行，进口铁矿石现货市场报价上调。重磅文件部署扩大内需，推动钢价上行，并带动炉料走高。整体上，贸易商多数看好后市，低价出货意愿不高。需求方面，受原材料上涨影响，钢厂采购力度偏弱，补库积极性不高，继续维持低库存运行。关注周五铁矿石港口库存。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	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