



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)	696.00	-18.50↓	I 主力合约持仓量(手)	760,338	+28886↑
	I 1-5合约价差 (元/吨)	37.5	-1.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	-28648	-4784↓
	I 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)	92.35	-1.45↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	804	-3↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	793	-3↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	722	-1↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	97	+15↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	96.50	-0.55↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.07	-0.05↓
	进口成本预估值(元/吨)	810	-4↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,452.10	-161.90↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,708.40	+266.90↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,075.64	-108.56↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,328.43	-859.46↓
	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, %)	62.56	-1.83↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	250.39	-31.26↓
	BDI指数	1,873.00	-31.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	23.35	-0.32↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.35	-0.15↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.81	0.00	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.14	+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, %)	27.42	+1.07↑	标的历史40日波动率(日, %)	34.68	+0.61↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	32.99	-2.47↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	32.46	-2.03↓
行业消息	1、13日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2605.91万吨，环比上期增63.68万吨，烧结粉总日耗102.76万吨，减9.34万吨。 2、根据Mysteel卫星数据显示，2022年10月3日-10月9日期间，澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1115.4万吨，周环比增加9.5万吨，库存总量仍在今年均值附近波动。					 更多资讯请关注！
观点总结	周四I2301合约增仓下行，进口铁矿石现货报价继续下调。贸易商报价积极性尚可，部分贸易商低价出货，钢厂则多持观望态度，按需采购为主。由于近期华北地区的烧结限产政策，目前对精粉需求有所收缩，部分钢厂采购积极性欠佳。同时钢价走弱挤压矿价。技术上，I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议，震荡偏空交易，注意风险控制。					 更多观点请咨询！
重点关注	周五铁矿石港口库存、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