

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) | 696.00 | -18.50↓ | 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↓ |
| | 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 | 澳洲铁矿石发运离港量(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) | 9.35 | -0.15↓ |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 23.35 | -0.32↓ | | | |
| | 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。 | | | | | |
| 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。 | | | | | |
| 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



更多资讯请关注！



更多观点请咨询！