

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) | 780.00 | +0.50↑ | 主力合约持仓量(手) | 645,663 | +47281↑ |
| | 1-5合约价差(元/吨) | 15.5 | -0.50↓ | 合约前20名净持仓(手) | 71323 | +4693↑ |
| | 大商所仓单(手) | 2,100.00 | -1300.00↓ | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨) | 108.45 | +0.10↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 853 | -9↓ | 青岛港61%麦克粉矿(元/干吨) | 834 | -1↓ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 726 | +31↑ | 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 38 | -1↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 109.60 | +2.30↑ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.71 | +0.03↑ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 899 | +10↑ | | | |
| 产业情况 | 澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,613.20 | +98.40↑ | 中国45港到港总量(周, 万吨) | 2,384.80 | +36.90↑ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 13,277.81 | -206.83↓ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 9,148.13 | +50.16↑ |
| | 铁矿石进口量(月, 万吨) | 9,498.00 | -473.00↓ | 铁矿石可用天数(周, 天) | 19.00 | 0.00 |
| | 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↑ |
| 下游情况 | BDI指数 | 1,323.00 | -1.00↓ | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 8.2 | +0.07↑ |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 19.33 | -0.24↓ | | | |
| | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 75.61 | -1.42↓ | 247家钢厂高炉产能用率(周, %) | 82.62 | +0.10↑ |
| | 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, %) | 29.28 | +1.00↑ | 标的历史40日波动率(日, %) | 32.82 | -0.14↓ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 34.93 | -1.34↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 35.78 | +4.69↑ |
| 行业消息 | 1、11月28日-12月4日中国47港到港总量2384.8万吨, 环比增加36.9万吨; 中国45港到港总量2318.7万吨, 环比增加58.3万吨; 北方六港到港总量为1304.7万吨, 环比增加277.8万吨。 2、11月28日-12月4日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2613.2万吨, 环比增加98.4万吨。澳洲发运量1923.0万吨, 环比增加60.4万吨, 其中澳洲发往中国的量1658.8万吨, 环比增加32.2万吨。巴西发运量690.3万吨, 环比增加38.0万吨。 | | | | | |
| | | | | | | |
| 观点总结 | 周二I2305合约区间整理, 进口铁矿石现货报价小幅回调。本期澳洲铁矿石发运量及到港量均小幅回升, 钢材需求增加预期对矿价支撑有所弱化。目前贸易商报价积极性一般, 多数贸易商挺价, 但市场交投氛围冷清, 钢厂按需采购, 延续低库存态势。技术上, I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA高位回调。操作上建议, 短线考虑于792-770区间高抛低买, 止损8元/吨。 | | | | | |
| | | | | | | |
| 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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!