



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)	658.50	-1.00↓	I主力合约持仓量(手)	585,323	+28640↑
	I1-5合约价差(元/吨)	-12.5	+4.00↑	I主力合约前20名净持仓(手)	-7996	+34↑
	I大商所仓单(手)	5,600.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	113.35	+0.90↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	753	+33↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	699	+30↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	484	+28↑	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	40	+31↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	108.55	+8.15↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	5.17	-0.24↓
	进口成本预估值(元/吨)	816	+58↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,790.30	+260.80↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,285.00	+327.10↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	15,456.93	+205.46↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,396.64	-208.04↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,495.50	+1334.50↑	铁矿石可用天数(周, 天)	30.00	+3.00↑
	全国126座矿山产能利用率(旬, %)	58.25	+0.76↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	202.40	+25.65↑
	BDI指数	3,352.00	+117.00↑			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	29.39	+0.27↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	14.15	+0.66↑
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	69.79	+0.13↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	74.80	-0.43↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,158	-217↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	62.03	-2.89↓	标的历史40日波动率(日, %)	64.64	-1.14↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	47.47	+3.36↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	44.18	+1.65↑
行业消息	<p>1、今年1-11月份, 蒙古国铁矿石(铁矿砂及精矿)出口总量为709.19万吨, 同比减少52.57万吨, 降幅6.90%。1-11月份, 中国是蒙古国铁矿石出口唯一目的地。今年11月份, 蒙古国铁矿石出口量为53.41万吨, 同比减少13.88万吨, 降幅20.63%; 环比减少7.60万吨, 降幅12.45%。</p> <p>2、Mineral Resources Limited(MRL) 已宣布与自动化设备供应商Hexagon合作开发自动化公路列车解决方案, 作为其采矿服务基础设施供应链解决方案的一部分。MRL自动公路列车将成为年产能3000万吨的Ashburton Hub 铁矿石项目供应链的重要</p>					 <p>更多资讯请关注!</p>
观点总结	<p>周三I2205合约震荡整理, 进口铁矿石现货市场报价继续上调。铁矿石供应仍处于宽松状态, 而钢厂全面复产暂未兑现, 铁水产量在低位徘徊, 终端需求没有明显提升。但受宏观面利好的影响, 市场情绪得以提振。技术上, I2205合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA继续向上走高。操作上建议, 日内偏多交易, 注意风险控制。</p>					 <p>更多观点请咨询!</p>
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