

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)	765.00	-15.00↓	I 主力合约持仓量(手)	670,470	+24807↑
	I 1-5合约价差 (元/吨)	25	+9.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	77336	+6013↑
	I 大商所仓单 (手)	1,900.00	-200.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	106.55	-1.86↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	861	+8↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	843	+10↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	728	+2↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	53	+15↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	109.70	+0.10↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.67	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	902	+4↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(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)	9,884.60	+386.60↑	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↑
	BDI指数	1,340.00	+17.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.16	-0.17↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.435	+0.24↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.61	-1.42↓	247家钢厂高炉产能利用率(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, %)	30.71	+1.43↑	标的历史40日波动率(日, %)	33.15	+0.33↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	35.38	+0.45↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	35.61	-0.17↓
行业消息	1、海关总署数据显示, 2022年11月中国进口铁矿石及其精矿9884.6万吨, 较上月增加387.1万吨, 环比增长4.1%; 1-11月累计进口铁矿石及其精矿101609.7万吨, 同比下降2.1%。 2、根据Mysteel卫星数据显示, 2022年11月28日-12月4日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1022万吨, 周环比降66万吨, 略低于今年平均水平。					 更多资讯请关注!
观点总结	周三I2305合约增仓回落。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均小幅回升, 同时11月中国进口铁矿石及其精矿9884.6万吨, 较上月增加387.1万吨, 环比增长4.1%, 另外12省份发布碳达峰实施方案, 鼓励电炉短流程炼钢, 铁矿石现货供应维持相对宽松, 短期在利空消息影响下或高位承压。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, 短线于795下方偏空交易, 注意风险控制。					 更多观点请咨询!
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