

撰写人：许方莉
 从业资格证号：F3073708
 投资咨询从业证书号：Z0017638

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)	847.50	+8.00↑	I 主力合约持仓量(手)	901,895	+25733↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	25.5	-0.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	79850	+3487↑
	I 大商所仓单 (手)	3,200.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	121.75	+1.75↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	913	+11↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	896	+14↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	771	+13↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	48	+6↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	122.15	+3.45↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.54	-0.06↓
	进口成本预估值(元/吨)	970	+28↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,267.40	-548.60↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,586.70	-240.00↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,130.54	-55.09↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,956.34	+39.49↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,885.00	+387.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	25.00	+4.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	56.05	-0.74↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	228.12	-4.30↓
	BDI指数	1,096.00	-43.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	0.00	-18.91↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	0	-7.40↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	74.64	-0.57↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	81.93	-0.66↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,454	-522↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	29.20	+0.05↑	标的历史40日波动率(日, %)	28.87	0.00
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.90	+2.20↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	30.53	-0.97↓
行业消息	1、根据Mysteel卫星数据显示, 2023年1月2日-1月8日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量974.4万吨, 周环比下降39.4万吨, 处于2022年偏低位置。 2、人民银行党委书记、银保监会主席郭树清表示, 将当期总收入最大可能地转化为消费和投资, 是经济快速恢复和高质量发展的关键, 金融服务大有可为。以满足新市民需求为重点, 开发更多适销对路的金融产品, 鼓励住房、汽车等大宗商品消费。					 更多资讯请关注！
观点总结	周三I2305合约震荡偏强, 进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均明显回落, 现货供应减少对矿价构成支撑。贸易商报盘积极性一般, 出货积极性较前期有所好转, 部分贸易商有投机操作。另外, 当前钢厂库存仍偏低, 伴随着春节假期临近, 仍存补库预期。技术上, I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上走高。操作上建议, 回调择机做多, 注意风险控制。					 更多观点请咨询！
重点关注						