

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)	650.50	-18.00↓	主力合约持仓量(手)	582,886	-5136↓
	1-5合约价差(元/吨)	10	+1.00↑	主力合约前20名净持仓(手)	-37602	-23611↓
	大商所仓单(手)	8,600.00	0.00			
现货市场	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/l)	112.95	-2.44↓			
	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	791	+32↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	755	+43↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	513	+33↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	105	+61↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	110.20	+7.60↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.93	-0.19↓
产业情况	进口成本预估值(元/吨)	828	+55↑			
	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,252.80	-537.50↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,164.20	-120.80↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	15,484.91	+27.98↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,314.50	-82.14↓
	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↑
下游情况	BDI指数	3,216.00	-56.00↓	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	13.555	-0.18↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	26.82	-0.43↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	68.14	-1.65↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	74.12	-0.68↓
期权市场	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,158	-217↓			
	标的的历史20日波动率(日, %)	59.77	+1.50↑	标的的历史40日波动率(日, %)	66.00	+0.31↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	46.13	-0.88↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	46.27	+0.52↑
行业消息	1、12月6日-12月12日本期Mysteel澳洲巴西19港铁矿石发运总量2252.8万吨, 环比减少537.5万吨; 澳洲发运量1759.4万吨, 环比减少226.8万吨; 其中澳洲发往中国的量1408.3万吨, 环比减少183.6万吨; 巴西发运量493.4万吨, 环比减少310.7万吨。 2、12月6日-12月12日 中国45港到港总量2164.2万吨, 环比减少120.8万吨; 北方六港到港总量为931.5万吨, 环比减少79.7万吨。					
观点总结	周二I2205合约减仓回落, 进口铁矿石现货市场报价松动。本期澳巴铁矿石发运总量及到港量明显减少一度支撑矿价走高, 但当前铁矿石现货供应整体维持宽松, 港口库存持续回升。钢厂依旧按需补库, 短期内进口矿市场供需存偏强预期, 价格或陷入区间宽幅整理。技术上, I2205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670-635区间高抛低买, 止损10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!