



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)	790.00	+25.00↑	I 主力合约持仓量(手)	714,255	+43785↑
	I 1-5合约价差 (元/吨)	24	-1.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	77336	+6013↑
	I 大商所仓单 (手)	2,200.00	+300.00↑			
	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)	858	-3↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	837	-7↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	723	-5↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	23	-31↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	107.45	-2.25↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.69	+0.03↑
	进口成本预估值(元/吨)	880	-22↓			
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)	21.00	+2.00↑
	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	1,373.00	+33.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.19	+0.03↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.78	+0.34↑
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月中国进口铁矿砂及其精矿9884.6万吨, 较上月增加387.1万吨, 环比增长4.1%; 1-11月累计进口铁矿砂及其精矿101609.7万吨, 同比下降2.1%。 2、12月8日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2608.19万吨, 环比上期增84.31万吨。烧结粉总日耗105.43万吨, 降1.04万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周四I2305合约增仓上行, 进口铁矿石现货市场报价相对平稳。随着期价反弹, 再次提振现货市场信心, 贸易商报盘积极性尚可, 出货情况较好, 部分钢厂有补库需求。整体上, 近期钢厂利润持续收窄, 采购较为谨慎, 多维持按需采购, 保持低库存运行模式。只是宏观利好消息持续作用, 市场预期较好。技术上, I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴上方。操作上建议, 日内短线交易, 注意风险控制。					 更多观点请咨询!
重点关注	周五国内铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率					

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