

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)	673.00	+24.00↑	主力合约持仓量(手)	611,925	+15710↑
	5-9合约价差(元/吨)	31.5	+2.50↑	主力合约前20名净持仓(手)	-30757	+13989↑
	大商所仓单(手)	8,600.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/l)	116.8	+4.27↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	783	+5↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	748	0.00
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	500	-2↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	75	-24↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	109.70	+1.45↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.98	0.00
	进口成本预估值(元/吨)	824	+9↑			
产业情况	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)	28.00	-2.00↓
	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	2,665.00	-267.00↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.909	-2.69↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	23.97	-1.91↓			
期权市场	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↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	6,931	-227↓			
行业消息	标的历20日波动率(日, %)	55.92	-3.81↓	标的历40日波动率(日, %)	62.91	-3.07↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	45.14	+1.96↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	46.06	+0.68↑
观点总结	1、16日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存3142.70万吨；烧结粉总日耗87.46万吨。原口径64家钢厂进口烧结粉总库存1380.47万吨；烧结粉总日耗43.92万吨；库存消费比31.43，烧结矿中平均使用进口矿配比90.34%。 2、美国众议院通过将联邦政府债务上限调高2.5万亿美元的法案，这使得美国财政部的借款授权可延长至2023年，暂时避免政府债务违约风险。					
	周四I2205合约震荡偏强，贸易商报价积极性提升，钢厂则维持按需采购为主。随着钢厂利润回升，12月上旬粗钢日均产量环比大幅增加，叠加钢价持续走高对铁矿石期价带来支撑，周五关注国内铁矿石港口库存。技术上，I2205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，回调择机做多，注意风险控制。					
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



更多资讯请关注！



更多观点请咨询！