



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)	673.50	-3.00↓	I 主力合约持仓量(手)	618,254	+16495↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	29.5	0.00	I 主力合约前20名净持仓(手)	-10781	+11629↑
	I 大商所仓单 (手)	8,400.00	-200.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	125.85	+5.97↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	815	-5↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	788	0.00
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	520	-2↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	115	+3↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	118.25	+3.55↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.77	0.00
	进口成本预估值(元/吨)	889	+29↑			
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)	15,696.30	+211.39↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,574.83	+260.33↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,495.00	+1334.00↑	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, %)	56.33	-1.92↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	213.87	+11.47↑
	BDI指数	2,379.00	-119.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.07	-0.88↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.023	-0.00↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	68.00	-0.14↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	74.28	+0.16↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	6,931	-227↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	53.80	-0.80↓	标的历史40日波动率(日, %)	61.19	+0.01↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	48.79	+3.37↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	46.06	+0.93↑
行业消息	1、据Mysteel获悉,自12月19日起,唐山市受弱气压场控制,风力小、湿度大,扩散条件差,将出现中至重度污染过程,达到橙色预警级别。为有效应对此轮污染过程,最大限度减轻污染程度,按照省大气办《关于加强管控积极应对本轮污染过程的提醒函》(冀气领办〔2021〕119号)要求,市重污染天气应对指挥部决定,自2021年12月19日12时全市启动重污染天气II级应急响应,具体解除时间另行通知。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2205合约承压回调,近日随着现货市场价格持续上涨,贸易商心态好转,挺价心态渐浓,但由于当前华北地区环保限产政策频出,钢厂依旧保持较低的补库需求,上周铁矿石港口库存继续增加,因此短期在部分钢厂复产预期及铁矿石现货供应宽松博弈下,矿价或陷区间宽幅整理。技术上,I2205合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议,短线于690-645区间高抛低吸,止损15元/吨。					 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