

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) | 835.50 | -0.50↓ | I 主力合约持仓量(手) | 859,385 | +6907↑ |
| | I 5-9合约价差(元/吨) | 25.5 | -1.00↓ | I 合约前20名净持仓(手) | 57460 | +5284↑ |
| | I 大商所仓单(手) | 4,300.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨) | 113.4 | -0.02↓ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 897 | +2↑ | 青岛港61%麦克粉矿(元/干吨) | 874 | +1↑ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 750 | +8↑ | I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 38 | +2↑ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 114.65 | +2.15↑ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.63 | -0.00↓ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 938 | +19↑ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,763.80 | +32.20↑ | 中国45港到港总量(周, 万吨) | 2,198.10 | -453.50↓ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 13,336.64 | -62.14↓ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 9,464.74 | +225.52↑ |
| | 铁矿石进口量(月, 万吨) | 9,885.00 | +387.00↑ | 铁矿石可用天数(周, 天) | 19.00 | 0.00 |
| | 全国126座矿山开工率(旬, %) | 56.79 | -0.66↓ | 全国126座矿山库存量(旬, 万吨) | 232.42 | -4.88↓ |
| | BDI指数 | 1,515.00 | -135.00↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 8.315 | -0.17↓ |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 20.07 | -2.12↓ | | | |
| | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 75.93 | -0.04↓ | 247家钢厂高炉产能用率(周, %) | 82.39 | -0.25↓ |
| | 国内粗钢产量(月, 万吨) | 7,454 | -522↓ | | | |
| 期权市场 | 标的历20日波动率(日, %) | 30.36 | -0.03↓ | 标的历40日波动率(日, %) | 30.25 | +0.04↑ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 34.32 | +0.03↑ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 34.32 | +0.24↑ |
| 行业消息 | 1、根据Mysteel卫星数据显示, 2022年12月19日-12月25日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1040.2万吨, 周环比下降87.3万吨, 略低于今年均值。 2、12月19日-12月25日中国47港到港总量2198.1万吨, 环比减少453.5万吨; 中国45港到港总量2079.1万吨, 环比减少449.3万吨; 北方六港到港总量为1130.4万吨, 环比减少48.3万吨。 | | | | | |
| 观点总结 | 周三I2305合约震荡偏强, 进口铁矿石现货报价上调。贸易商报盘积极性一般, 成交量则变化不大, 仅部分钢厂有采购需求。当前下游终端处于淡季, 需求依旧偏弱, 钢厂基本按需补库为主, 但伴随后期元旦和春节假期即将来临, 补库预期较强。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, 回调择机短多, 注意风险控制。 | | | | | |
| 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!



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!