



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	+69071↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	25.5	-1.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	57460	+52841↑
	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	+21↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	874	+11↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	750	+81↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	38	+21↑
	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	+191↑			
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:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.07	-2.12↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.315	-0.17↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.93	-0.04↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	82.39	-0.25↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,454	-522↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	30.36	-0.03↓	标的历史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。				 更多资讯请关注!	
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。				 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!