

| 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) | 969.50 | +14.50↑ | I 主力合约持仓量(手) | 502,723 | +19492↑ |
| | I 1-5合约价差(元/吨) | 52 | 0.00 | I 合约前20名净持仓(手) | 78140 | -4700↓ |
| | I 大商所仓单(手) | 2,100.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报(美元/吨) | 135.75 | +0.75↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 1,065 | -1↓ | 天津港61%麦克粉矿(元/干吨) | 1,050 | -1↓ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 941 | 0.00 | I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 81 | -16↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 136.85 | -0.55↓ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 3.05 | +0.00↑ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 1,131 | -4↓ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,744.90 | +76.30↑ | 中国47港到港总量(周, 万吨) | 2,534.10 | -40.90↓ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 11,817.83 | +323.26↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 9,455.23 | +152.83↑ |
| | 铁矿石进口量(月, 万吨) | 10,274.30 | +336.30↑ | 铁矿石可用天数(周, 天) | 23.00 | +1↑ |
| | 全国186座矿山开工率(旬, %) | 68.94 | +0.97↑ | 全国186座矿山日产量(旬, 万吨) | 43.49 | +0.61↑ |
| 下游情况 | BDI指数 | 2,509.00 | +26.00↑ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 12.5 | +1.61↑ |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 28.59 | +0.47↑ | | | |
| | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 78.73 | -2.15↓ | 247家钢厂高炉产能利用率(周, %) | 85.73 | -1.88↓ |
| | 国内粗钢产量(月, 万吨) | 7,909 | -302↓ | | | |
| 期权市场 | 标的历历史20日波动率(日, %) | 24.14 | +0.64↑ | 标的历历史40日波动率(日, %) | 23.73 | +0.21↑ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 28.46 | +3.29↑ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 28.52 | +3.68↑ |
| 行业消息 | 1、12月4日-12月10日中国47港到港总量2534.1万吨, 环比减少40.9万吨; 中国45港到港总量2453.7万吨, 环比减少20.7万吨; 北方六港到港总量为1434.8万吨, 环比增加253.7万吨。 2、12月4日-12月10日 Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2744.9万吨, 环比增加76.3万吨。澳洲发运量2010.5万吨, 环比增加290.5万吨, 其中澳洲发往中国的量1711.6万吨, 环比增加256.1万吨。巴西发运量734.4万吨, 环比减少214.3万吨。 | | | | | |
| 观点总结 | 周二I2405合约震荡走高, 进口铁矿石现货报价相对平稳。本期澳巴铁矿石到港量小幅回落, 但发运量增加。近期, 铁矿石港口库存延续累库趋势, 而在钢厂利润仍处于亏损状态下, 钢厂采购仍以按需补库为主。只是I2405合约仍贴水现货较深, 存基差修复可能。技术上, I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA高位运行。操作上建议, 回调择机做多, 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!

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444
 助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823
 王世霖 期货从业资格号F03118150

备注: I: 铁矿石
 期货投资咨询从业证书号Z0013101
 王凯慧 期货从业资格号F03100511



更多资讯请关注!



免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料, 瑞达期货股份有限公司力求准确可靠, 但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证, 据此投资, 责任自负。本报告不构成个人投资建议, 客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有, 未经书面许可, 任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发, 需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院, 且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。