

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)	643.50	-19.00↓	主力合约持仓量(手)	783,488	+14125↑
	1-5合约价差(元/吨)	32	-4.50↓	合约前20名净持仓(手)	-58580	-16950↓
	大商所仓单(手)	1,500.00	-1500.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	86.5	-2.34↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	762	-10↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	750	-7↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	674	+21↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	107	+12↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	87.80	0.00	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.19	+0.04↑
	进口成本预估值(元/吨)	745	-1↓			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,511.60	+39.70↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,464.80	+212.70↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,912.76	-79.94↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,431.38	+34.51↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,971.00	+350.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	18.00	-3.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	54.16	-3.65↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	241.60	-8.40↓
	BDI指数	1,706.00	0.00	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	9.005	0.00
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.94	0.00			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.05	-0.57↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	88.26	-0.78↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,695	+308↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	26.00	+0.35↑	标的历史40日波动率(日, %)	31.28	+0.10↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.13	-1.77↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.32	+1.82↑
行业消息	1、2022年9月, 铁矿石采购成本继续下降。2022年1-9月, 国产铁精矿同比下降26.61%, 进口粉矿同比下降28.02%; 废钢同比下降0.28%。 2、晋南钢铁截止到目前晋南厂区三座高炉全部停产, 日影响铁水产量约在2.1万吨; 星原厂区两座550m ³ 高炉继续停产, 日影响铁水产量约在0.4万吨; 宇丰厂区一座450m ³ 高炉继续停产, 日影响铁水产量约在0.15万吨。					
观点总结	周四12301合约大幅下挫, 进口铁矿石现货报价下调。终端成交不及预期, 市场整体情绪较为低迷; 仅个别钢厂有采购需求, 多数持观望状态。近期钢价持续走弱, 钢厂利润收缩较为明显, 减产意愿增强, 对于铁矿的需求有所下降, 港口疏港量下降, 可能进一步挤压矿价。技术上, 12301合约1小时MACD指标显示绿色动能柱持续扩散。操作上建议, 震荡偏空交易, 注意风险控制。					
重点关注	10月28日Mysteel 钢厂开工率及高炉产能利用率					

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!