瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

铁矿石产业链日报

2022/9/22

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）	718.00	+14.50↑	I 主力合约持仓量(手)	742,035	+19165↑
	I 1-5合约价差（元/吨）	41	+1.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	-15211	+3051↑
	I 大商所仓单（手）	2,400.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨	98..2	+2.54↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	815	+13↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	802	+11↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	720	+1↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	84	-4↓
	铁矿石62%普氏指数（美元/吨）	96.40	-0.25↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.07	-0.06↓
	进口成本预估值(元/吨)	795	+1↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周，万吨)	2,541.80	+167.70↑	中国45港到港总量(周，万吨)	2,519.20	+172.00↑
	45港铁矿石港口库存量(周，万吨)	13,718.92	+29.94↑	样本钢厂铁矿石库存量(周，万吨)	9,783.88	+69.78↑
	铁矿石进口量(月，万吨)	9,621.00	+497.00↑	铁矿石可用天数(周，天)	21.00	+2.00↑
	全国126座矿山开工率(旬，%)	64.39	-0.87↓	全国126座矿山库存量(旬，万吨)	281.65	-3.93↓
	BDI指数	1,746.00	+17.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	23.82	+0.11↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.49	+0.14↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周，%)	82.41	+0.42↑	247家钢厂高炉产能用率(周，%)	88.32	+0.76↑
	国内粗钢产量(月，万吨)	8,387	+244↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日，%)	36.15	+0.33↑	标的历史40日波动率(日，%)	40.96	+0.36↑
	平值看涨期权隐含波动率(日，%)	35.35	-0.11↓	平值看跌期权隐含波动率(日，%)	35.20	-1.13↓

行业消息

1、美联储公布9月利率决议，如期加息75个基点，至3.00-3.25%。经济预期显示未来或进一步加速升息步伐。美联储FOMC 9月点阵图显示，美联储预计在2022年至少还会加息75个基点，直到2024年才会降息。

2、Mysteel预估9月中旬粗钢产量增速放缓，全国粗钢预估产量2886.01万吨，日均产量288.60万吨，环比9月上旬上升0.91%，同比上升5.15%。

更多资讯请关注！

观点总结

周四I2301合约增仓上行，进口铁矿石现货报价上调。美联储公布9月利率决议，如期加息75个基点，至3.00-3.25%，随着加息落地，市场空头情绪得到释放。贸易商报价积极性提高，临近国庆假期，部分钢厂陆续提高了补库节奏，预计后续补库需求将进一步扩大。技术上，I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上走高。操作上建议，700上方偏多交易，注意风险控制。

更多观点请咨询！

重点关注

周五铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率

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