

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)	840.00	-6.50↓	I 主力合约持仓量(手)	855,024	-19006↓
	I 5-9合约价差 (元/吨)	22.5	+0.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	78086	-4947↓
	I 大商所仓单 (手)	4,200.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	114.7	-0.36↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	908	-16↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	885	-18↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	759	-11↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	45	-12↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	117.00	-0.65↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.58	+0.07↑
	进口成本预估值(元/吨)	946	-8↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,816.00	+52.20↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,826.60	+628.50↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,185.63	-151.01↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,504.23	+39.49↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,885.00	+387.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	25.00	+4.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	56.05	-0.74↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	228.12	-4.30↓
	BDI指数	1,176.00	-74.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.85	-0.11↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.32	-0.11↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.21	-0.72↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	82.59	+0.20↑
	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, %)	28.43	-0.96↓	标的历史40日波动率(日, %)	27.73	+0.15↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	38.16	-0.85↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	38.16	-0.91↓
行业消息	1、美国联邦储备委员会4日公布的2022年12月货币政策会议纪要显示，美联储官员重申了对降低通胀的决心，警告市场不要低估其将在一段时间内维持高利率的意愿。 2、05日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2961.7万吨，环比上期增289.01万吨。烧结粉总日耗105.45万吨，降0.71万吨。					 更多资讯请关注！
观点总结	周四I2305合约减仓整理，进口铁矿石现货报价下调。贸易商报价积极性尚可，出货多随行就市，部分有挺价行为，部分钢厂有采购需求。当前钢厂库存仍偏低，伴随着春节假期临近，仍存补库预期。技术上，I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议，日内短线交易，注意风险控制。					 更多观点请咨询！
重点关注	周五国内铁矿石港口库存、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