瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

铁矿石产业链日报

2023/12/21

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）	968.00	+29.00↑	I 主力合约持仓量(手)	522,954	+24173↑
	I 1-5合约价差（元/吨）	61	-5.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	78154	-1551↓
	I 大商所仓单（手）	3,500.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	136.85	+2.94↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	1,062	+9↑	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	1,051	+12↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	941	+5↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	83	-17↓
	铁矿石62%普氏指数（美元/吨）	134.95	+1.15↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.11	-0.03↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,113	+10↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周，万吨)	2,687.30	-57.60↓	中国47港到港总量(周，万吨)	2,615.50	+81.40↑
	45港铁矿石港口库存量(周，万吨)	11,588.65	-229.18↓	样本钢厂铁矿石库存量(周，万吨)	9,448.08	-7.15↓
	铁矿石进口量(月，万吨)	10,274.00	+336.00↑	铁矿石可用天数(周，天)	19.00	0.00
	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↑
	BDI指数	2,219.00	-69.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.14	-0.37↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	13.93	-0.50↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周，%)	78.29	-0.44↓	247家钢厂高炉产能用率(周，%)	84.81	-0.92↓
	国内粗钢产量(月，万吨)	7,610	-299↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日，%)	26.01	+2.06↑	标的历史40日波动率(日，%)	22.37	+1.16↑
	平值看涨期权隐含波动率(日，%)	26.34	-0.05↓	平值看跌期权隐含波动率(日，%)	27.26	-0.07↓
行业消息	1、12月11日-12月17日 Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2687.3万吨，环比减少57.6万吨。澳洲发运量1900.4万吨，环比减少110.2万吨，其中澳洲发往中国的量1544.2万吨，环比减少167.4万吨。巴西发运量787.0万吨，环比增加52.6万吨。 2、21日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2545.85万吨，环比上期降55.56万吨。烧结粉总日耗112.32万吨，降0.57万吨。库存消费比22.67，降0.38。					
观点总结	周四I2405合约增仓反弹，进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石发运量小幅下滑，而到港量增加。贸易商出货积极性尚可，价格多小幅上涨；个别钢厂按需补库，谨慎询盘。整体上，国际油价走高、钢厂增加采购预期及期货贴水现货支撑期价上行。技术上，I2405合约1小时 MACD指标显示DIFF与 DEA向上走高。操作上建议，回调择机做多，止损参考940					
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率					

更多资讯请关注！

数据来源第三方，观点仅供参考。市场有风险，投资需谨慎！

备注：I：铁矿石

研究员：蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101

助理研究员：李秋荣 期货从业资格号F03101823 王凯慧 期货从业资格号F03100511

王世霖 期货从业资格号F03118150

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。