

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)	1,002.00	+23.00↑	I 主力合约持仓量(手)	551,896	+26105↑
	I 1-5合约价差 (元/吨)	59	+1.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	73740	+381↑
	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)	141.9	+3.16↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	1,099	+7↑	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	1,086	+10↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	973	0.00	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	84	-13↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	140.50	+1.60↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.07	-0.01↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,154	+12↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,757.40	-123.80↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,909.90	+718.20↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	11,988.61	+99.01↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,526.95	+36.98↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,274.00	+336.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	22.00	+3↑
	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	2,094.00	0.00			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	26.56	+1.03↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.55	+0.70↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.17	-2.52↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	82.73	-2.00↓
	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, %)	25.13	+0.29↑	标的历史40日波动率(日, %)	23.16	+0.65↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	26.80	+8.77↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	26.85	+6.63↑
行业消息	1、12月25日-12月31日中国47港到港总量2909.9万吨, 环比增加718.2万吨; 中国45港到港总量2774.9万吨, 环比增加715.1万吨; 北方六港到港总量为1360.5万吨, 环比增加314.8万吨。 2、12月25日-12月31日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2757.4万吨, 环比减少123.8万吨。澳洲发运量1811.9万吨, 环比减少210.2万吨, 其中澳洲发往中国的量1565.4万吨, 环比减少165.8万吨。巴西发运量945.5万吨, 环比增加86.4万吨。					
观点总结	周二I2405合约增仓上行, 进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石发运量减少, 但到港量明显增多, 将增加铁矿石现货供应。贸易商报价积极性尚可, 多随行就市, 只是市场交投氛围一般。受钢厂冬储补库预期下, 铁矿石贸易商挺价情绪较浓, 叠加期货贴水现货较深, 支撑期价走高。技术上, I2405合约1小时 MACD指标显示DIFF与 DEA向上反弹。操作上建议, 震荡偏多交易, 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 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

备注: I: 铁矿石

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。