

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)	992.00	-8.00↓	I 主力合约持仓量(手)	541,088	-8912↓
	I 1-5合约价差 (元/吨)	105	+20.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	79231	-3870↓
	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)	137.75	-0.83↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	1,110	-5↓	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	1,095	-5↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	982	-5↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	103	+31↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	140.10	-1.65↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	2.99	-0.01↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,154	-13↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,115.20	-642.20↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,860.00	-49.90↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,241.79	+250.06↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,785.83	+258.88↑
	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	0.00
	全国186座矿山开工率(旬, %)	63.88	-0.28↓	全国186座矿山日产量(旬, 万吨)	49.88	-0.22↓
	BDI指数	2,110.00	+24.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	29.35	+0.17↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.78	-0.14↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.63	+0.44↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	81.59	-1.16↓
	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, %)	25.12	-0.35↓	标的历史40日波动率(日, %)	23.26	-0.12↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	25.53	-0.53↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	26.78	+1.29↑
行业消息	1、1月1日-1月7日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2115.2万吨, 环比减少642.2万吨。澳洲发运量1697.6万吨, 环比减少114.3万吨, 其中澳洲发往中国的量1448.2万吨, 环比减少117.2万吨。巴西发运量417.6万吨, 环比减少527.9万吨。 2、1月1日-1月7日中国47港到港总量2860万吨, 环比减少49.9万吨; 中国45港到港总量2771.2万吨, 环比减少3.7万吨; 北方六港到港总量为1441.8万吨, 环比增加81.3万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2405合约再度走弱, 进口铁矿石现货报价下调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均出现下滑, 将减少铁矿石现货供应。贸易商报价积极性较低, 多为随行就市, 整体出货意愿不高, 多持观望态度; 钢厂按需补库, 市场交投氛围较冷清。由于钢厂利润收缩, 向上挤压炉料, 同时铁矿石港口库存连续回升, 只是期货贴水现货, 因此期价或陷入区间宽幅波动。技术上, I2405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。					
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。