



项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	主力合约收盘价(元/吨)	962.00	-32.00↓	主力合约持仓量(手)	518,327	-22685↓
	5-9合约价差(元/吨)	77	-0.50↓	合约前20名净持仓(手)	75565	-2044↓
	大商所仓单(手)	3,400.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	132.75	-5.01↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,089	-21↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,074	-18↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	984	-11↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	112	+14↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	139.10	-0.30↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.03	+0.02↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,147	-2↓			
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	+253.18↑	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	2,022.00	-88.00↓			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	29.00	-0.35↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.64	-0.14↓
	247家钢厂高炉开工率(周,%)	75.65	+0.48↑	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	81.57	-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,%)	25.62	+2.59↑	标的历史40日波动率(日,%)	25.72	+2.66↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	25.01	+5.26↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	25.67	+5.45↑
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。					 <p>更多资讯请关注!</p>
观点总结	周三I2405合约减仓下行,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。贸易商报价积极性尚可,挺价情绪减弱;钢厂利润不佳多维持刚需补库,采购谨慎。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,期价连续回调。技术上,I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上建议,震荡偏空交易,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!

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。