

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)	976.50	+14.50↑	I主力合约持仓量(手)	528,880	+10553↑
	I5-9合约价差(元/吨)	80	+3.00↑	I合约前20名净持仓(手)	69074	-649↓
	I大商所仓单(手)	4,400.00	+1000.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	134.15	+1.32↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,087	-3↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,077	0.00
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	979	-5↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	100	-15↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	134.35	-4.75↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.03	+0.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,109	-38↓			
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)	23.00	+1↑
	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	1,664.00	-211.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.73	-1.31↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.4	-0.40↓
下游情况	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	I标的历史20日波动率(日,%)	24.68	-0.94↓	I标的历史40日波动率(日,%)	24.77	-0.95↓
	I平值看涨期权隐含波动率(日,%)	25.12	+0.11↑	I平值看跌期权隐含波动率(日,%)	25.45	-0.22↓
行业消息	1、11日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2688.81万吨,环比上期增147.38万吨。烧结粉总日耗110.66万吨,增2.37万吨。库存消费比24.3,增0.83。 2、1月10日,河北邯郸、邢台、沧州、衡水,湖北襄阳和河南衡水等多地发布重污染天气预警。在确保安全生产和民生保障的前提下,全地域严格按照应急减排有关要求落实各项应急减排措施。解除时间根据会商研判结果另行通知。					
观点总结	周四I2405合约止跌反弹。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高,出货意愿增强;钢厂询盘尚可,成交增加。关注周五铁矿石港口库存变化,目前钢厂需求减弱,但铁矿石期价贴水现货,多空因素交织,行情波动或有反复。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,短线于1000-950区间高抛低买,止损参考15元/吨。					
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!

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。