



撰写人：许方莉 从业资格证号：F3073708 投资咨询从业证书号：Z0017638

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)	841.50	+6.50↑	I 主力合约持仓量(手)	833,380	-21236↓
	I 5-9合约价差 (元/吨)	26	-2.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	60768	-10267↓
	I 大商所仓单 (手)	5,500.00	-300.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	121.7	+1.06↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	918	+9↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	899	+7↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	788	+11↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	57	+0↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	121.50	+0.75↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.52	-0.03↓
	进口成本预估值(元/吨)	963	+11↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,193.80	-73.60↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,476.90	-109.70↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,358.93	+228.39↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,241.19	+39.49↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,086.00	-799.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	27.00	+2.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	55.80	-0.25↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	213.62	-14.50↓
	BDI指数	921.00	-25.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	17.93	+0.10↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.19	-0.29↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.68	+1.04↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	82.56	+0.63↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,789	+335↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	33.46	-0.20↓	标的历史40日波动率(日, %)	31.81	-0.95↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	32.55	-1.27↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	33.54	+1.92↑
行业消息	1、近日，国家发展改革委价格司、市场监管总局价监竞争局、证监会期货部组织部分铁矿石贸易企业和期货公司召开会议，分析铁矿石市场和价格形势，详细了解有关企业参与铁矿石现货和期货交易情况，提醒告诫有关企业依法合规经营，不得编造发布虚假信息，不得选择性引用数据和信息、故意渲染涨价氛围，不得捏造散布涨价信息，不得哄抬价格，不得过度投机炒作。 2、1月9日-1月15日 中国47港到港总量2476.9万吨，环比减少109.7万吨；中国45港到港总量2370.1万吨，环比减少112.3万吨；北方六港到港总量为1254.2万吨，环比减少181.2万吨。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周三I2305合约高位整理，进口铁矿石现货报价上调。据悉多数钢厂节前补库基本结束，仅有个别按需询价，但贸易商仍看好后市，挺价情绪较浓，短线行情或有反复，注意操作节奏。技术上，I2305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，日内短线交易，注意风险控制。					 <div>更多观点请咨询！</div>
重点关注						