



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)	933.00	-15.50↓	I主力合约持仓量(手)	518,901	-3274↓
	I5-9合约价差(元/吨)	77.5	-6.50↓	I合约前20名净持仓(手)	71369	-3697↓
	I大商所仓单(手)	5,500.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	127.6	-2.09↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,080	-2↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,066	0.00
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	957	-16↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	133	+161↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	131.20	-4.55↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.07	+0.031↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,084	-36↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨)	2,287.00	+171.80↑	中国47港到港总量(周,万吨)	3,091.10	+231.10↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	12,617.43	+375.64↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,981.49	+195.66↑
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,086.10	-187.90↓	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	1,460.00	-94.00↓			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.30	-0.79↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.97	-0.12↓
	247家钢厂高炉开工率(周,%)	76.10	+0.45↑	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	82.58	+1.01↑
	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,%)	27.38	+0.53↑	标的历史40日波动率(日,%)	25.88	+0.11↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	23.72	+2.67↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	23.44	+2.93↑
行业消息	1、1月8日-1月14日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2287.0万吨,环比增加171.8万吨。澳洲发运量1573.9万吨,环比减少123.7万吨,其中澳洲发往中国的量1254.1万吨,环比减少194.0万吨。巴西发运量713.1万吨,环比增加295.5万吨。 2、1月8日-1月14日中国47港到港总量3091.1万吨,环比增加231.1万吨;中国45港到港总量2949.4万吨,环比增加178.2万吨;北方六港到港总量为1486.6万吨,环比增加44.8万吨。					 <p>更多资讯请关注!</p>
观点总结	周一I2405合约减仓回落,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回升,将增加铁矿石现货供应。贸易商报价积极性不高,多随行就市。钢厂利润收缩向上挤压炉料,钢厂多是逢低采购,刚需补库为主。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!

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。