

| 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 | +16↓ |
| | 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 | +0.03↑ |
| | 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!

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。