瑞达期货 RUIDA FUTURES CO.,LTD.

铁矿石产业链日报

2022/1/13

撰写人：陈一兰　从业资格证号：F3010136　投资咨询从业证书号：Z0012698

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）	726.00	-11.50↓	I 主力合约持仓量(手)	646,778	-18027↓
	I 5-9合约价差（元/吨）	27.5	-2.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	-18193	-4710↓
	I 大商所仓单（手）	11,100.00	+1000.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/	127.25	-3.97↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	918	+16↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	886	+11↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	593	+18↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	160	+22↑
	铁矿石62%普氏指数（美元/吨）	131.60	+3.00↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.41	-0.05↓
	进口成本预估值(元/吨)	980	+20↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周，万吨)	2,235.40	-560.50↓	中国45港到港总量(周，万吨)	2,710.90	+110.30↑
	45港铁矿石港口库存量(周，万吨)	15,605.10	-20.55↓	样本钢厂铁矿石库存量(周，万吨)	11,060.99	+79.28↑
	铁矿石进口量(月，万吨)	10,495.00	+1334.00↑	铁矿石可用天数(周，天)	28.00	-2.00↓
	全国126座矿山产能利用率(旬，%)	57.78	+1.45↑	全国126座矿山库存量(旬，万吨)	226.22	+12.35↑
	BDI指数	2,027.00	-124.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.83	-0.63↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.064	-0.84↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周，%)	74.20	+4.16↑	247家钢厂高炉产能用率(周，%)	77.89	+2.10↑
	国内粗钢产量(月，万吨)	6,931	-227↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日，%)	36.26	+0.74↑	标的历史40日波动率(日，%)	48.86	+0.27↑
	平值看涨期权隐含波动率(日，%)	40.55	+0.39↑	平值看跌期权隐含波动率(日，%)	38.80	-0.39↓

行业消息

1、13日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存3590.76万吨，烧结粉总日耗100.27万吨。原口径64家钢厂进口烧结粉总库存1579.50万吨，烧结粉总日耗49.12万吨，库存消费比32.16，烧结矿中平均使用进口矿配比89.02%。

2、据皮尔巴拉港务局数据显示，2021年12月黑德兰港口铁矿石出口总量为5080万吨，环比增加17.1%，同比增加9.3%。其中出口到中国的铁矿石总量达4212万吨，环比增加15.4%，同比增加5.4%。出口到韩国和日本的铁矿石总量分别为338万吨、315万吨。

更多资讯请关注！

观点总结

周四I2205合约减仓回落，贸易商报价积极性尚可，但受期价回落影响部分贸易商午后随行就市，以出货为主。近日巴西暴雨及国内钢材增产预期持续支撑矿价走高，只是随着期现货价格大幅上行高位压力徒增，市场将焦点再度转移到周五的库存数据上。技术上，I2205合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议，短线于710-740区间低买高抛，止损10元/吨。

更多观点请咨询！

重点关注

周五国内港口库存、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！

备注：I：铁矿石