



项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	主力合约收盘价(元/吨)	926.00	-12.50↓	主力合约持仓量(手)	519,137	+3868↑
	5-9合约价差(元/吨)	75.5	0.00	合约前20名净持仓(手)	64815	-1894↓
	大商所仓单(手)	4,100.00	-700.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	125.6	-3.71↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,069	+2↑	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,061	+11↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	957	+11↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	135	+23↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	129.45	+0.50↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.11	+0.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,071	+5↑			
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	1,324.00	-36.00↓			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.27	-1.60↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.81	-0.08↓
	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)	6,744	-866↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	27.68	+0.37↑	标的历史40日波动率(日,%)	25.57	+0.01↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	23.06	+0.41↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	20.75	-3.19↓
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、国家统计局数据显示:2023年12月,中国粗钢产量6744万吨,同比下降14.9%;生铁产量6087万吨,同比下降11.8%;钢材产量10850万吨,同比增长1.5%。1-12月,中国粗钢产量101908万吨,同比持平;生铁产量87101万吨,同比增长0.7%;钢材产量136268万吨,同比增长5.2%。					 更多资讯请关注!
观点总结	周三I2405合约承压走弱,进口铁矿石现货报价涨跌互现。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。贸易商报价积极性较低,整体出货意愿不高,多持观望态度;钢厂询货积极性一般,按需补库,市场交投氛围冷清。钢厂利润收缩向上挤压炉料,同时股市疲软打压市场信心。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,维持反弹择机短空,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

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。