

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	主力合约收盘价(元/吨)	715.00	+10.00↑	主力合约持仓量(手)	620,758	-1330↓
	5-9合约价差(元/吨)	28.5	+0.50↑	合约前20名净持仓(手)	-20878	+9176↑
	大商所仓单(手)	12,700.00	-1500.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/l)	126.85	+2.73↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	880	-5↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	851	-8↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	560	-8↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	136	-18↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	124.00	-2.75↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.59	+0.04↑
	进口成本预估值(元/吨)	925	-21↓			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,348.30	+112.90↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,569.90	-141.00↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	15,697.19	+92.09↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	11,495.13	+434.14↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	8,607.40	-1887.60↓	铁矿石可用天数(周, 天)	30.00	0.00
	全国126座矿山产能利用率(旬, %)	61.97	+4.19↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	244.70	+18.48↑
下游情况	BDI指数	1,731.00	-33.00↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.473	+0.46↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.96	-0.22↓			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.77	+1.57↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	79.89	+2.00↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,619	+1688↑			
行业消息	标的历史20日波动率(日, %)	36.04	+0.15↑	标的历史40日波动率(日, %)	45.49	-0.75↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	39.76	-1.29↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	41.46	-0.27↓
观点总结	1、1月10日-1月16日本期Mysteel澳洲巴西19港铁矿石发运总量2348.3万吨，环比增加112.9万吨；澳洲发运量1786.5万吨，环比增加71.8万吨；其中澳洲发往中国的量1495.8万吨，环比增加95.2万吨；巴西发运量561.8万吨，环比增加41.1万吨。 2、四季度皮尔巴拉业务铁矿石产量为8412万吨，环比三季度增加1%，同比减少2%。2021年全年总产量达3.197亿吨，同比减少4%。2021年总产量减少的主要原因为2021年上半年降雨量较高，叠加COVID-19的持续蔓延使得劳动力紧张，位于Gudai-Darri和Robe Valley两地的矿区投产被推迟。					
	周二I2205合约先抑后扬，由于本期澳洲铁矿石发运总量回升，叠加淡水河谷重申2022年铁矿石产量指导仍为3.2亿吨至3.35亿吨，铁矿石期价一度承压，但随着发改委及央行相关言论利好市场及钢价走高对矿价构成支撑。短期矿价或陷入区间宽幅整理。技术上，I2205合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位反弹。操作上建议，705附近短多，止损695。					
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



更多资讯请关注！



更多观点请咨询！