

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)	828.00	+3.00↑	I 主力合约持仓量(手)	837,305	-450↓
	I 1-5合约价差(元/吨)	11.5	-1.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	64361	-8902↓
	I 大商所仓单(手)	2,800.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/I)	110.65	+0.10↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	880	-17↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	859	-16↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	745	-5↓	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	31	-19↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	112.50	+0.85↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.69	+0.07↑
	进口成本预估值(元/吨)	923	+7↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,763.80	+32.20↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,198.10	-453.50↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,398.78	+14.16↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,464.74	+225.52↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,885.00	+387.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	19.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	56.79	-0.66↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	232.42	-4.88↓
	BDI指数	1,515.00	-135.00↓	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	8.315	-0.17↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.07	-2.12↓			
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.97	+0.08↑	247家钢厂高炉产能用率(周, %)	82.64	+0.64↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,454	-522↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	30.72	-0.12↓	标的历史40日波动率(日, %)	32.22	+1.34↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	33.39	+7.94↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	35.35	+8.97↑
行业消息	1、12月19日-12月25日Mysteel澳洲巴西19港铁矿石发运总量2763.8万吨，环比增加32.2万吨。澳洲发运量1970.5万吨，环比减少54.5万吨，其中澳洲发往中国的量1622.5万吨，环比减少189.4万吨。巴西发运量793.2万吨，环比增加86.7万吨。 2、12月19日-12月25日中国47港到港总量2198.1万吨，环比减少453.5万吨；中国45港到港总量2079.1万吨，环比减少449.3万吨；北方六港到港总量为1130.4万吨，环比减少48.3万吨。					
观点总结	周一I2305合约震荡偏强。本期铁矿石到港总量2198.1万吨，环比减少453.5万吨，供应收缩提振市场信心。部分贸易商低价出货意愿不强，多有挺价情绪。需求方钢厂仍处亏损边缘，低利润情况难以好转，钢厂受高矿价影响，节前补库节奏或将放缓。技术上，I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴上方。操作上建议，日内短线交易，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！



更多资讯请关注！



更多观点请咨询！