

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)	776.00	+9.50↑	主力合约持仓量(手)	625,399	-1877↓
	5-9合约价差(元/吨)	32.5	+3.00↑	合约前20名净持仓(手)	-17087	-2466↓
	大商所仓单(手)	1,500.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	137.8	+1.00↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	960	+30↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	927	+27↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	624	+41↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	151	+18↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	137.85	+4.15↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.21	-0.13↓
	进口成本预估值(元/吨)	1,020	+27↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,163.80	-184.50↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,382.80	-187.10↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	15,435.81	-261.38↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	11,710.55	+215.42↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	8,607.00	-1888.00↓	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	1,343.00	-48.00↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.323	-0.41↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.73	-0.29↓			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	76.25	+0.48↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	81.08	+1.19↑
	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, %)	30.73	-0.81↓	标的历史40日波动率(日, %)	37.78	-0.13↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	39.68	-0.43↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	42.04	-0.08↓
观点总结	1、1月17日-23日, 中国47港铁矿石到港总量2382.8万吨, 环比减少187.1万吨; 中国45港铁矿石到港总量2204.3万吨, 环比减少302.5万吨; 北方六港铁矿石到港总量为1084.5万吨, 环比减少101.7万吨。 2、1月17日-23日, 澳洲巴西19港铁矿石发运总量2163.8万吨, 环比减少184.5万吨; 澳洲发运量1715.5万吨, 环比减少71.0万吨; 其中澳洲发往中国的量1441.1万吨, 环比减少54.7万吨; 巴西发运量448.3万吨, 环比减少113.5万吨。					 更多资讯请关注!
	周三I2205合约继续走高, 据悉随着假期临近, 钢厂节前补库基本结束, 仅个别钢厂有少量补库需求, 但本期澳巴铁矿石发运总量及国内到港量均出现下滑, 支撑铁矿石期价走高, 短线行情波动较大, 注意操作节奏。技术上, I2205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, 短线以MA5日均线为多空分水岭, 注意风险控制。					 更多观点请咨询!
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