

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)   | 845.00    | +9.50↑   | I 主力合约持仓量(手)         | 885,333  | +25948↑   |
|      | I 5-9合约价差(元/吨)   | 26        | +0.50↑   | I 合约前20名净持仓(手)       | 69232    | +11772↑   |
|      | I 大商所仓单(手)   | 4,300.00  | 0.00     |                      |          |   |
|      | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)  | 14.65     | +1.52↑   |                      |          |   |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)   | 904       | +8↑      | 青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)     | 884      | +10↑  |
|      | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)   | 755       | +5↑      | I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 39       | +0↑   |
|      | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨)   | 114.75    | +0.10↑   | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)  | 3.59     | -0.04↓  |
|      | 进口成本预估值(元/吨)   | 940       | +21↑     |                      |          |   |
| 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)   | 13,336.64 | -62.14↓  | 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↓  |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)   | 20.07     | -2.12↓   |                      |          |   |
|      | 247家钢厂高炉开工率(周, %)  | 75.93     | -0.04↓   | 247家钢厂高炉产能用率(周, %)   | 82.39    | -0.25↓  |
|      | 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, %)   | 30.33     | -0.03↓   | 标的历史40日波动率(日, %)     | 30.26    | +0.01↑  |
|      | 平值看涨期权隐含波动率(日, %)  | 34.40     | +0.08↑   | 平值看跌期权隐含波动率(日, %)    | 35.24    | +0.92↑  |
| 行业消息 | 1、全国发展和改革工作会议在京召开。国家发改委主任李立峰指出，要更好统筹疫情防控和经济社会发展。着力稳增长、稳就业、稳物价，大力提振市场信心，积极扩大国内有效需求，充分发挥消费的基础作用和投资的关键作用，推动经济运行整体好转。<br>2、Mysteel调研182份下游样本，结果显示，超过90%的下游企业表示不会在节前进行对于来年一季度的提前采购。综合预计，1月份螺纹钢消费量约700万吨出头，占全年比重约3.3%，同比下滑27%。 |           |          |                      |          | <br>更多资讯请关注！  |
| 观点总结 | 周四I2305合约增仓上行，进口铁矿石现货报价上调。贸易商报价积极性尚可，出货多随行就市，而钢厂买盘较弱，多持观望态度。当前下游终端处于淡季，需求依旧偏弱，钢厂基本按需补库为主，但伴随后期元旦和春节假期即将来临，补库预期较强。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，回调仍可考虑择机短多，注意风险控制。  |           |          |                      |          | <br>更多观点请咨询！ |
| 重点关注 | 周五铁矿石港口库存、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！