



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	+2↑			
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)	20.07	-2.12↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.315	-0.17↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.93	-0.04↓	247家钢厂高炉产能利用率(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。国家发改委主任何立峰指出，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。 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%。				 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。				 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！