

撰写人: 许方莉 从业资格证号: F3073708 投资咨询从业证书号: Z0017638

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)	832.50	-48.50↓	主力合约持仓量(手)	863,044	-90246↓
	5-9合约价差(元/吨)	28.5	+1.50↑	合约前20名净持仓(手)	79809	-24938↓
	大商所仓单(手)	7,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	119.3	-6.20↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	913	-22↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	896	-14↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	766	-28↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	63	+34↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	127.00	+3.35↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.54	+0.05↑
	进口成本预估值(元/吨)	998	+23↑			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,193.80	-73.60↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,476.90	-109.70↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,358.93	+228.39↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,241.19	+39.49↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,085.90	-799.10↓	铁矿石可用天数(周, 天)	27.00	+2.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	55.80	-0.25↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	213.62	-14.50↓
	BDI指数	946.00	-30.00↓	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	7.18	+0.08↑
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	17.71	-0.08↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.68	+1.04↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	82.56	+0.63↑
	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, %)	36.06	+6.53↑	标的历史40日波动率(日, %)	32.93	+3.48↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	33.79	+5.12↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	33.33	-0.75↓
行业消息	1、1月9日-1月15日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2193.8万吨, 环比减少73.6万吨。澳洲发运量1778.0万吨, 环比减少29.9万吨, 其中澳洲发往中国的量1497.4万吨, 环比减少38.4万吨。巴西发运量415.8万吨, 环比减少43.7万吨。 2、1月9日-1月15日中国47港到港总量2476.9万吨, 环比减少109.7万吨; 中国45港到港总量2370.1万吨, 环比减少112.3万吨; 北方六港到港总量为1254.2万吨, 环比减少181.2万吨。					
观点总结	周一I2305合约减仓下挫, 进口铁矿石现货报价下调。发改委再次关注近期铁矿石价格上涨问题, 同时要求不得编造发布虚假信息, 不得捏造散布涨价信息, 不得哄抬价格, 市场情绪受挫, 矿价走弱。据悉多数钢厂节前补库基本结束, 仅有个别按需询, 但贸易商仍看好后市, 挺价情绪较浓, 短线行情或有反复, 注意操作节奏。技术上, I2305合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议, 短线考虑于845-815区间高抛低买, 止损10元/吨。					
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!