



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	I 主力合约收盘价 (元/吨)	832.50	-48.50↓	I 主力合约持仓量(手)	863,044	-90246↓
	I 5-9合约价差 (元/吨)	28.5	+1.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	79809	-24938↓
	I 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↓	I 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	澳巴铁矿石发运离港量(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)	17.71	-0.08↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.18	+0.08↑
下游情况	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。					 更多资讯请关注！
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。					 更多观点请咨询！
重点关注						