

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)	683.00	-30.50↓	I 主力合约持仓量(手)	654,535	-8267↓
	I 5-9合约价差 (元/吨)	37	-6.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	-35202	-5527↓
	I 大商所仓单 (手)	10,000.00	+1900.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	122.2	-5.23↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	891	+9↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	864	+20↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	545	+1↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	181	+50↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	125.05	+1.30↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.40	-0.10↓
	进口成本预估值(元/吨)	935	+9↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,754.40	+177.10↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,097.40	-133.30↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	15,512.60	-183.70↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,810.29	+235.46↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,495.00	+1334.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	28.00	-2.00↓
	全国126座矿山产能利用率(旬, %)	56.33	-1.92↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	213.87	+11.47↑
	BDI指数	2,217.00	-2.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	21.36	-0.14↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.945	+0.08↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	67.87	-0.13↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	74.33	+0.05↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	6,931	-227↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	44.22	-0.94↓	标的历史40日波动率(日, %)	59.08	+0.58↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	45.46	-2.91↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	44.83	+2.48↑
行业消息	1、12月20日-12月26日本期Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2754.4万吨, 环比增加177.1万吨; 澳洲发运量1956.1万吨, 环比增加52.4万吨; 其中澳洲发往中国的量1537.7万吨, 环比减少127.2万吨; 巴西发运量798.3万吨, 环比增加124.7万吨。 2、中国45港到港总量2097.4万吨, 环比减少133.3万吨; 北方六港到港总量为1100.3万吨, 环比增加39.6万吨。				 更多资讯请关注!	
观点总结	周一I2205合约减仓下行, 进口铁矿石现货报价松动。本期澳巴铁矿石发运总量增加, 而到港量继续下滑, 港口库存因疏港量增加结束十二连增, 但当前铁矿石港口库存仍高于去年同期水平, 现货供应依然处于宽松状态, 叠加钢价走弱将拖累矿价。技术上, I2205合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议, 700附近偏空交易, 止损参考710。				 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