

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)	942.00	-6.00↓	主力合约持仓量(手)	484,392	-1032↓
	1-5合约价差(元/吨)	62	+2.00↑	合约前20名净持仓(手)	79970	+1830↑
	大商所仓单(手)	3,500.00	+1400.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	133.6	-2.51↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	0	-1065↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	0	-1052↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	941	-51↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	-942	-1046↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	135.90	-2.15↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.08	+0.02↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,122	-18↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,744.90	+76.30↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,534.10	-40.90↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	11,817.83	+323.26↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,455.23	+152.83↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,274.30	+336.30↑	铁矿石可用天数(周, 天)	19.00	-4↓
	全国186座矿山开工率(旬, %)	68.94	+0.97↑	全国186座矿山日产量(旬, 万吨)	43.49	+0.61↑
下游情况	BDI指数	2,438.00	-113.00↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	13.79	+0.26↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	28.49	-0.29↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	78.73	-2.15↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	85.73	-1.88↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,909	-302↓			
期权市场	标的历历史20日波动率(日, %)	25.30	+1.16↑	标的历历史40日波动率(日, %)	24.47	+0.74↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	27.22	-1.24↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.91	+1.39↑
行业消息	<p>1、国联联邦储备委员会宣布，将联邦基金利率目标区间维持在5.25%至5.5%的水平不变，符合市场普遍预期。鲍威尔指出，降息已开始进入视野，决策者正在思考、讨论何时降息合适。美联储更新的利率预测中值显示2024年降息75个基点至4.6%，长期联邦基金利率预期为2.5%。</p> <p>2、14日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2601.41万吨，环比上期增61.95万吨。烧结粉总日耗112.89万吨，增0.98万吨。库存消费比23.04，增0.35。</p>					
观点总结	<p>周四I2405合约震荡偏弱，进口铁矿石现货报价下调。本期澳巴铁矿石到港量小幅回落，但发运量增加。贸易商出货积极性尚可，个别家因成本原因暂不出货；因大雪天气，终端需求和运力有所影响，钢厂拿货较为谨慎。关注周五港口库存数据，若继续提升将拖累矿价。技术上，I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下回落。操作上建议，震荡偏空交易，注意风险控制。</p>					
重点关注	周五国内铁矿石港口库存、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！

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101
 助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823 王凯慧 期货从业资格号F03100511
 王世霖 期货从业资格号F03118150

备注: I: 铁矿石



免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，瑞达期货股份有限公司力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发，需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。