

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)	923.00	-5.00↓	I主力合约持仓量(手)	486,363	+4683↑
	I1-5合约价差(元/吨)	70.5	-1.50↓	I合约前20名净持仓(手)	78611	-1697↓
	I大商所仓单(手)	3,500.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	132.2	-0.28↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,044	0.00	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,031	+21↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	920	-5↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	108	+7↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	133.95	-1.65↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.15	+0.02↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,104	-12↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨)	2,687.30	-57.60↓	中国47港到港总量(周,万吨)	2,615.50	+81.40↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	11,588.65	-229.18↓	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,448.08	-7.15↓
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,274.00	+336.00↑	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↑
	BDI指数	2,288.00	-60.00↓			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.51	-0.28↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	14.43	-0.14↓
	247家钢厂高炉开工率(周,%)	78.29	-0.44↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	84.81	-0.92↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	7,610	-299↓			
期权市场	I标的历史20日波动率(日,%)	23.74	-0.46↓	I标的历史40日波动率(日,%)	20.92	-1.48↓
	I平值看涨期权隐含波动率(日,%)	28.45	+0.79↑	I平值看跌期权隐含波动率(日,%)	27.71	-0.07↓
行业消息	1、12月11日-12月17日 Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2687.3万吨,环比减少57.6万吨。澳洲发运量1900.4万吨,环比减少110.2万吨,其中澳洲发往中国的量1544.2万吨,环比减少167.4万吨。巴西发运量787.0万吨,环比增加52.6万吨。 2、12月11日-12月17日中国47港到港总量2615.5万吨,环比增加81.4万吨;中国45港到港总量2583.4万吨,环比增加129.7万吨;北方六港到港总量为1357万吨,环比减少77.8万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周二I2405合约震荡偏弱,进口铁矿石现货报价涨跌互现。本期澳巴铁矿石发运量小幅下滑,而到港量增加。贸易商出货积极性尚可,价格多随行就市,钢厂按需补库,市场交投氛围一般。近期因天气原因,港口压港船只增加,库存呈小幅波动态势,港口恢复作业后,港口库存或将延续累库的趋势。技术上,I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位整理。操作上建议,反弹择机抛空,注意风险控制。					
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

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

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。