



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)	751.50	-12.50↓	主力合约持仓量(手)	404,650	+19152↑
	5-9合约价差(元/吨)	22.5	-2.50↓	合约前20名净持仓(手)	-1292	+427↑
	大商所仓单(手)	3,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	96.5	-1.71↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	0	-829↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	0	-802↓
	京唐港56.5%超特粉矿(元/干吨)	720	-11↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	-752	-790↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	98.80	-2.25↓	江苏废钢/青岛港60.8%麦克粉矿(比值)	3.58	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	832	-18↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨)	2,624.10	-314.10↓	中国47港到港总量(周,万吨)	2,919.10	+320.80↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	14,880.68	+21.40↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,858.93	+214.81↑
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,186.00	-198.00↓	铁矿石可用天数(周,天)	23.00	+1↑
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	38.45	+0.38↑	全国186座矿山开工率(旬,%)	60.65	0.00
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	36.35	-0.50↓	BDI指数	1,072.00	+43.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.33	+0.29↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.94	+0.44↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	78.08	-0.61↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	84.53	-1.00↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	7,840	-348↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	21.27	+0.60↑	标的历史40日波动率(日,%)	21.86	-0.85↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	22.28	+3.53↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	21.70	+2.38↑
行业消息	1、2024年12月30日-01月05日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2624.1万吨,环比减少314.1万吨。澳洲发运量1946.2万吨,环比减少243.5万吨,其中澳洲发往中国的量1466.2万吨,环比减少332.8万吨。巴西发运量677.8万吨,环比减少70.7万吨。 2、2024年12月30日-2025年01月05日中国47港到港总量2919.1万吨,环比增加320.8万吨;中国45港到港总量2834.3万吨,环比增加328.9万吨;北方六港到港总量为1378.4万吨,环比增加229.2万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一铁矿石2505合约增仓下行。宏观面,河北省召开安全生产工作会议,会议强调落实防控措施。基本面,本期澳巴铁矿石发运量减少,到港量增加,整体上供应端维持宽松,而铁矿水产量延续小幅下降趋势,钢厂冬储积极性不高。技术上,I2505合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上建议,反弹择机抛空,注意操作节奏和风险控制。					
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

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。