

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)	754.50	+7.00↑	I主力合约持仓量(手)	417,032	-442↓
	I5-9合约价差(元/吨)	21.5	0.00	合约前20名净持仓(手)	-1311	-4122↓
	I大商所仓单(手)	2,400.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	97.25	+0.30↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	818	0.00	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	790	-5↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	683	-5↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	36	-12↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	97.10	-0.15↓	铁废价差	155.00	+84.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	819	-1↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(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↓	45港口日均疏港量(周,万吨)	318.35	-5.79↓
	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	1,053.00	-49.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.69	-0.25↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.86	-0.32↓
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↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	225.14	-2.66↓
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	20.16	+0.50↑	标的历史40日波动率(日,%)	21.48	+0.12↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	28.12	-0.18↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	27.71	+0.52↑
行业消息	1.印度尼西亚继续对涉华热轧板卷征收反倾销税。 2.姜维:2023年—2024年培育期内,从报送的80余家示范培育企业统计来看,2年内这些企业一共投入节能改造资金417亿元,平均单个企业投入资金达5亿元,折合吨钢节能项目改造资金投入达78元,推进极致能效工程可帮助企业降低吨钢用能成本约26元,极致能效工程的节能项目平均回收期不到3年。				 更多资讯请关注!	
观点总结	1月9日,铁矿2505合约收盘754.5,上涨0.53%。宏观面,美国候任总统特朗普正在考虑宣布国家经济紧急状态,以为对盟友和对手实施大范围的普遍关税提供法律依据。基本面,供应维持宽松,本期铁水产量225.20万吨,环比降2.67万吨,年同比增加7.03万吨,需求端面临季节性回落压力。驱动方面,铁矿跟随成材波动为主,成材冬储价市场预期目前在3100-3300元/吨。市场方面,1月6日,焦炭开启第六轮提降。技术方面,4小时周期K线位于20和60均线下方,操作上,震荡对待,请投资者注意风险控制。					
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

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。