

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)	783.00	+14.50↑	I主力合约持仓量(手)	423,549	+15803↑
	I5-9合约价差(元/吨)	24	+1.00↑	合约前20名净持仓(手)	-6244	+4494↑
	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)	100.5	+1.65↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	850	+7↑	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	826	+12↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	705	+1↑	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	43	-3↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	99.20	+1.60↑	铁废价差	182.00	+18.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	836	+13↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	2,387.50	-236.60↓	中国47港到港总量(周,万吨)	2,416.30	-502.70↓
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	15,006.63	+125.95↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	10,074.08	+215.15↑
	铁矿石进口量(月,万吨)	11,248.60	+1062.60↑	45港口日均疏港量(周,万吨)	326.35	+8.00↑
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	39.60	+1.15↑	全国186座矿山开工率(旬,%)	62.46	+1.81↑
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	38.40	+2.05↑	BDI指数	1,015.00	+45.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	17.33	+0.36↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.525	+0.39↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	77.16	-0.92↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	84.22	-0.31↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	7,840	-348↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	224.31	-0.83↓
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	21.80	+1.04↑	标的历史40日波动率(日,%)	19.63	-1.17↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	28.27	-0.06↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	28.05	+0.03↑
行业消息	1. 中国人民银行、国家外汇局决定将企业和金融机构的跨境融资宏观审慎调节参数从1.5上调至1.75,于2025年1月13日实施。 2. 中国外汇市场指导委员会会议在北京召开。会议讨论了近期外汇市场形势,部署了加强外汇自律管理有关工作。会议强调,要坚定不移保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定。				更多资讯请关注!	
观点总结	1月14日,铁矿2505合约收盘783.0,上涨2.22%。宏观面,欧盟六国呼吁对俄罗斯石油设定每桶60美元的价格上限,认为这将减少莫斯科可用于支撑乌克兰战争的收入。基本面,库存高位,本期铁水产量224.37万吨,环比降0.83万吨,同比增加3.58万吨,关注发运情况。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,焦炭第六轮提降落地。技术上方,4小时周期K线位于20和60均线上方,操作上,震荡偏多对待,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。