

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)	797.00	+14.50↑	I主力合约持仓量(手)	457,983	+29405↑
	I5-9合约价差(元/吨)	22.5	0.00	合约前20名净持仓(手)	3389	+8047↑
	I大商所仓单(手)	3,400.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	102.45	+1.90↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	857	+4↑	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	832	+4↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	714	+9↑	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	35	-10↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	100.90	+0.20↑	铁废价差	92.00	+7.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	850	+2↑			
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	-17.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	17.33	-0.16↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.525	+0.09↑
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,%)	21.07	-0.61↓	标的历史40日波动率(日,%)	19.55	+0.52↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	27.64	-0.46↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	27.71	-0.11↓
行业消息	<p>1. 我的钢铁调研: 今年山西放假停产时间超过20天(含20天)的煤矿有所增加, 达到了38座, 涉及产能5120万吨。</p> <p>2. Mysteel: 目前在产的497座煤矿当中, 调研结果显示, 截止1月15日, 总共有454座煤矿已安排煤矿春节假期停产, 合计产能7.63亿吨, 影响原煤产量2005万吨。</p>				<p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结	<p>1月16日, 铁矿2505合约收盘797.0, 上涨1.92%。宏观面, 美国12月核心CPI同比上涨3.2%, 低于11月的同比涨幅3.3%, 促使金融市场押注美联储要到6月才会降息。基本面, 库存高位, 本期铁水产量224.37万吨, 环比降0.83万吨, 年同比增加3.58万吨, 一季度发运预计偏淡, 关注发运及港存去化情况。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。技术上方面, 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。</p>					
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。