

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)	810.50	+4.00↑	I主力合约持仓量(手)	487,496	-8026↓
	I5-9合约价差(元/吨)	37	+2.50↑	I合约前20名净持仓(手)	20180	-1082↓
	I大商所仓单(手)	2,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	105.05	+0.10↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	873	+8↑	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	848	+5↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	725	+10↑	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	37	+1↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	105.25	+1.30↑	铁废价差	152.00	+9.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	883	+10↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	1,868.70	+132.70↑	中国47港到港总量(周,万吨)	2,711.30	+534.20↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	14,930.26	-122.47↓	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	10,846.32	+581.61↑
	铁矿石进口量(月,万吨)	11,249.00	+1063.00↑	45港口日均疏港量(周,万吨)	330.21	-2.08↓
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	40.23	+0.63↑	全国186座矿山开工率(旬,%)	63.31	+0.85↑
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	35.77	-2.63↓	BDI指数	928.00	-46.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	17.68	-0.39↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.255	-0.10↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	78.00	+0.84↑	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	84.66	+0.36↑
	国内粗钢产量(月,万吨)	7,597	-243↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	225.51	+0.97↑
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	17.94	-2.10↓	标的历史40日波动率(日,%)	18.61	-0.27↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	26.31	0.00	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	26.58	0.00
行业消息	<p>1.哥伦比亚拒绝两架载有被遣返移民的美国军用飞机入境。特朗普表示,他将哥伦比亚实施包括关税和制裁在内的全面报复措施。</p> <p>2.中钢协:2024年12月,煤焦类品种采购成本环比下降,铁矿类品种环比上升。1-12月,炼焦煤采购成本同比下降8.72%;冶金焦同比下降12.41%;国产铁精矿同比下降1.68%,进口粉矿同比下降6.23%;废钢同比下降8.75%。</p>					
	<p>1月27日,铁矿2505合约收盘810.5,上涨1.06%。宏观方面,欧洲央行执委表示,欧元区银行需要一种数字欧元来应对特朗普大力推广稳定币的举措。基本面,库存同期高位,本期到港量环比增加534.2万吨,本期铁水产量225.45万吨,环比增加0.97万吨,同比增加2.16万吨,本期到港量环比减少239.3万吨,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>					
观点总结						
重点关注						



更多资讯请关注!



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。