

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)	780.00	+11.00↓	I主力合约持仓量(手)	369,932	-9528↓
	I5-9合约价差(元/吨)	24.5	+0.50↓	合约前20名净持仓(手)	11580	+5285↑
	I大商所仓单(手)	1,900.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	101.7	+1.15↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	842	+7↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	814	+5↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	714	+7↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	34	-6↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	100.90	-1.15↓	铁废价差	42.00	+1.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	849	-10↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	2,480.20	-97.70↓	中国47港到港总量(周,万吨)	2,277.10	-132.10↓
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	14,978.40	-85.22↓	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,571.70	+139.80↑
	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)	324.34	-12.70↓
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	39.21	-1.09↓	全国186座矿山开工率(旬,%)	62.45	-1.81↓
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	35.45	-0.35↓	BDI指数	1,053.00	+14.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	16.69	+0.08↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	6.86	+0.14↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	79.61	-0.92↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	86.11	-1.15↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	7,840	-348↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	229.36	-3.05↓
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	18.28	-0.21↓	标的历史40日波动率(日,%)	22.51	-0.18↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	24.91	-2.23↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	26.76	+0.05↑
行业消息	1.美国宣布向中国台湾地区提供军援军售,我外交部回应,强烈不满、坚决反对,已第一时间向美方提出严正交涉。 2.2024年12月16日-12月22日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2480.2万吨,环比减少97.7万吨。澳洲发运量1707.4万吨,环比减少126.6万吨,其中澳洲发往中国的量1560.6万吨,环比增加18.2万吨。巴西发运量772.8万吨,环比增加28.9万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	12月23日,铁矿2505合约收盘780,上涨0.84%。宏观面,美国当选总统特朗普表示,欧盟应加强进口美国石油和天然气,否则美国将欧盟出口的汽车和机械等商品征收关税。基本面,供应维持宽松,本期铁水产量229.41万吨,环比降3.06万吨,年同比增加2.77万吨,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3200-3300元/吨。技术上方面,4小时周期K线位于20和60均线之间,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
徐玉花 期货从业资格号F03132080 期货投资咨询从业证书号Z0021386
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。