



长城期货
GREAT WALL FUTURES

螺纹钢、铁矿石 期货品种周报

2026.01.05-01.09



长城期货

深耕期货行业

30年



长城期货
GREAT WALL FUTURES

P A R T

01

螺纹钢期货



长城期货
GREAT WALL FUTURES

目录

Contents

01 中线行情分析

02 品种交易策略

03 相关数据情况



1

中线趋势判断

根据长城期货AI智能大数据量化策略模型综合分析，螺纹钢期货主力合约运行于2882至3330的横盘整理区间。

2

趋势判断逻辑

螺纹钢周度产量184万吨，表观消费量200万吨，主要钢厂库存133万吨，社会库存430万吨。长城期货AI智能投询品种诊断报告显示螺纹钢期货主力合约运行于横盘整理区间。

3

中线策略建议

整理阶段可考虑网格交易策略，系统策略建议：天线3330，地线2882，网格间距32，网格数量14。



■ 上周策略回顾

螺纹钢期货主力合约进入震荡整理区间。

■ 本周策略建议

根据长城期货AI智能大数据量化策略模型，螺纹钢期货主力合约进入横盘整理区间，可考虑实施大网格交易策略。

■ 现货企业套期保值建议

整理阶段建议观望等待新一轮中线趋势明朗。

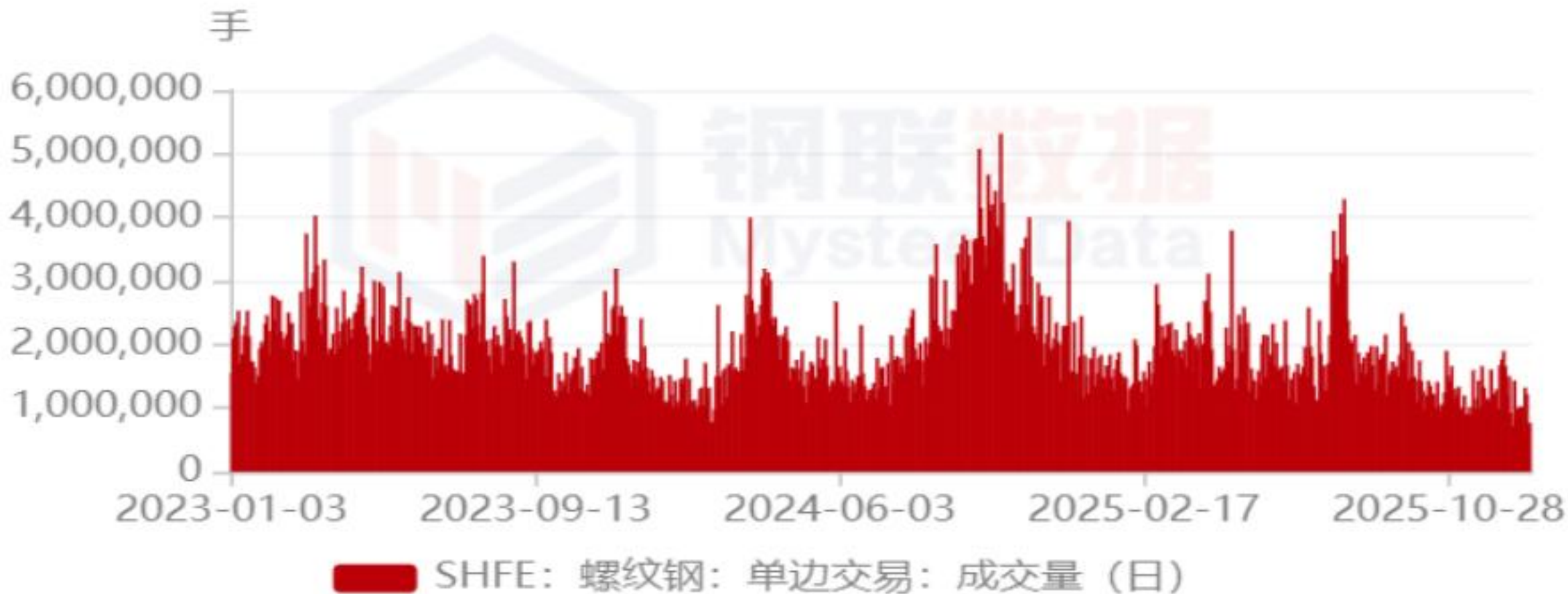
螺纹钢消费量

+ ⚠ 📍 📉 📊 ⬇ 🔍 ↺



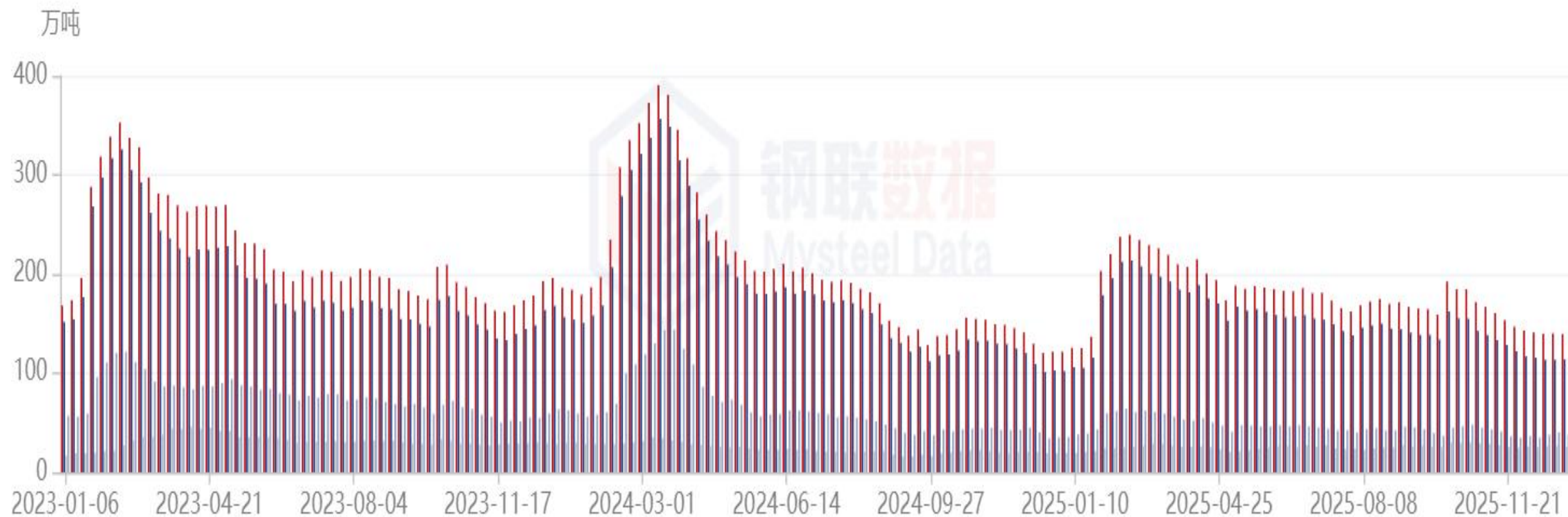
螺纹钢成交量

+ ⚠️ 📍 📉 📊 ⬇️ 🔍 ↺



螺纹钢厂内库存

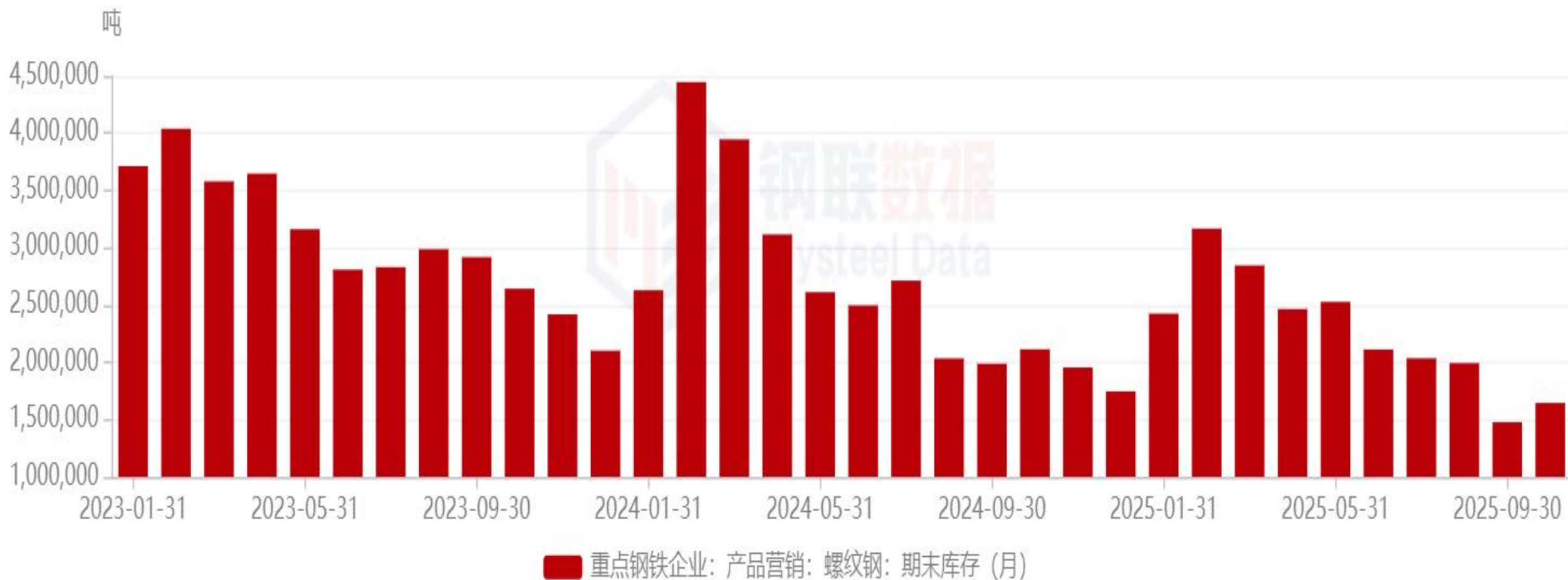
+ ⚠ 📍 ⏮ ⏭ ⏴ ⏵ ↺



■ 螺纹钢: 建筑钢材钢铁企业: 厂内库存: 中国 (周) ■ 螺纹钢: 建筑钢材钢铁企业: 厂内库存: 中国: 长流程 (周) ■ 螺纹钢: 建筑钢材钢铁企业: 厂内库存: 中国: 短流程 (周) ◀ 1/2 ▶

螺纹钢期末库存

+ ⚠ 📍 📈 📉 ⬇ ⬆ ↺



< 螺纹(rb) v

品种诊断 机构观点 盈利席位 主力资金

- AI品种诊断报告 -

看整体趋势，日线处在横盘阶段，根据近年来行情周期的规律，当前可能还在趋势中段。

资金方面，主力空头阵营略占优势。同时，主力资金快速撤出。



技术面 01-01 15:13:28

分钟趋势

5分钟线横盘整理，趋势或近尾声

-10.0

看整体趋势，5分钟线处在横盘阶段。根据近几日行情周期的规律，当前可能已近趋势尾声。



< 螺纹(rb) v

品种诊断 机构观点 盈利席位 主力资金

多空流向: -27.8 主力略微偏空

资金能量: -85.3 主力资金快速撤出

多空分歧: 62.6 变盘风险不大

如何通过三大主力指标，对行情的方向、量级、风险快速做出判断? 查看>

多空流向: -27.8 12-31 17:57 说明②

主力空头阵营略占优势

• 螺纹品种前20持仓今日流空3.137亿，AI评分为-27.8，在历史上属于较小幅度的流空。







长城期货
GREAT WALL FUTURES

P A R T

02

铁矿石期货



长城期货
GREAT WALL FUTURES

目录

Contents

01 中线行情分析

02 品种交易策略

03 相关数据情况



1

中线趋势判断

根据长城期货AI智能数据模型综合因素分析，铁矿石期货主力合约处于红色阶梯通道第一周。

2

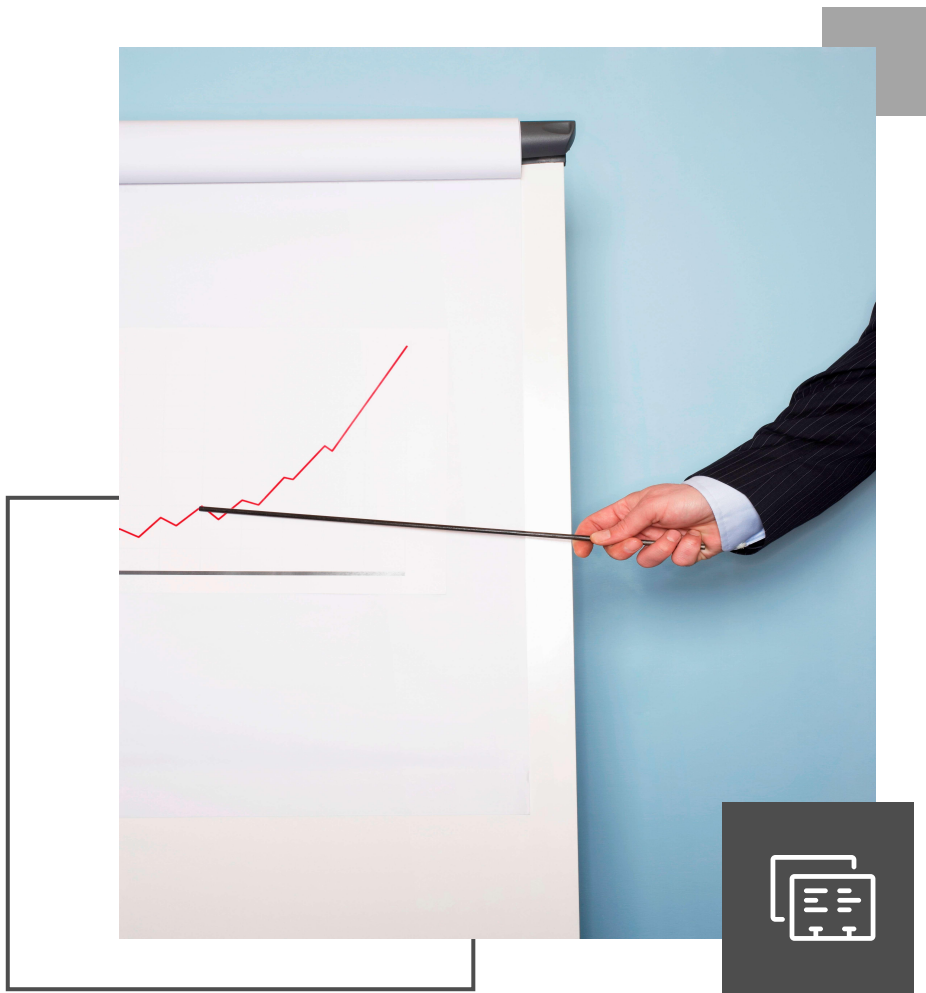
趋势判断逻辑

供应方面，铁矿石上周全球发运量3677万吨，中国45个主要港口到货量2601万吨，钢铁企业库存8946万吨，国内主要港口库存15970万吨。长城期货AI智能投询品种诊断显示铁矿石中线趋势处于红色阶梯通道之中。

3

中线策略建议

钢材生产企业可考虑实施多方保值策略。



■ 上周策略回顾

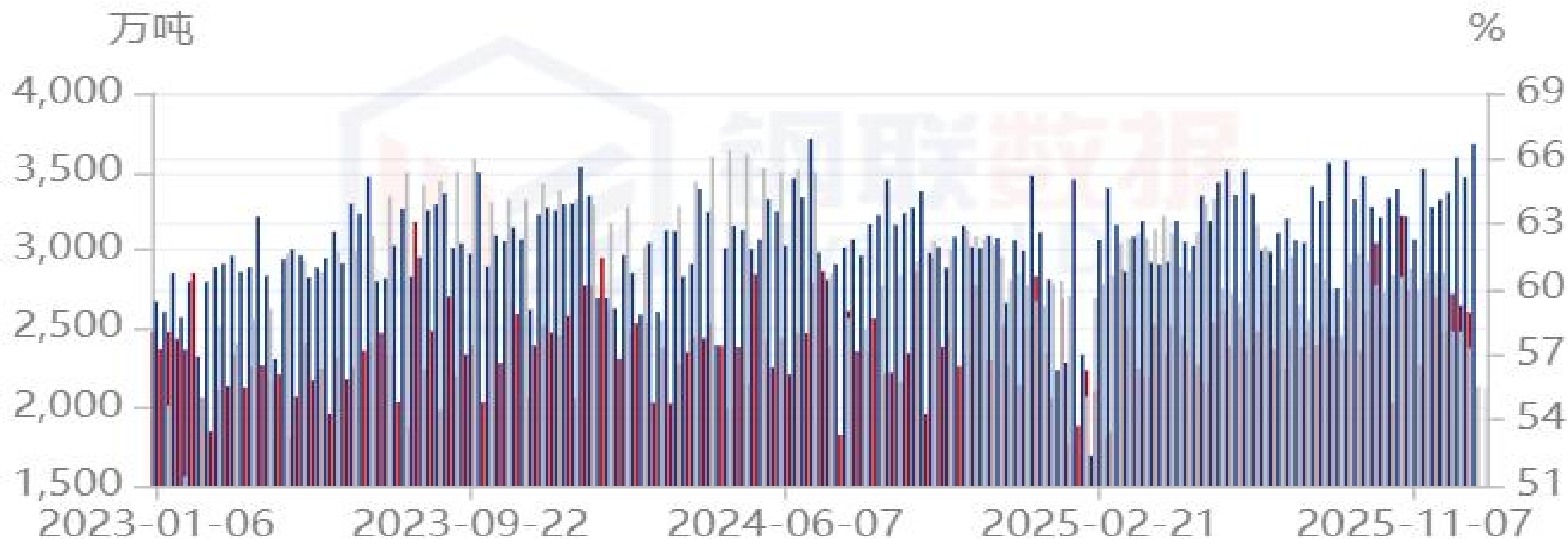
长城期货AI智能数据模型品种诊断报告显示，铁矿石中线价格处于区间震荡整理阶段。

■ 本周策略建议

钢材生产及下游需求企业可考虑分步实施30%多方保值策略。

中国铁矿石供给分析

十 ⚠️ 📍 📈 📉 ⬇️ 🔍 ↺



■ 铁矿：到港量：45个港口（周） ■ 铁矿：发货量：全球（周） 1/2 ▶

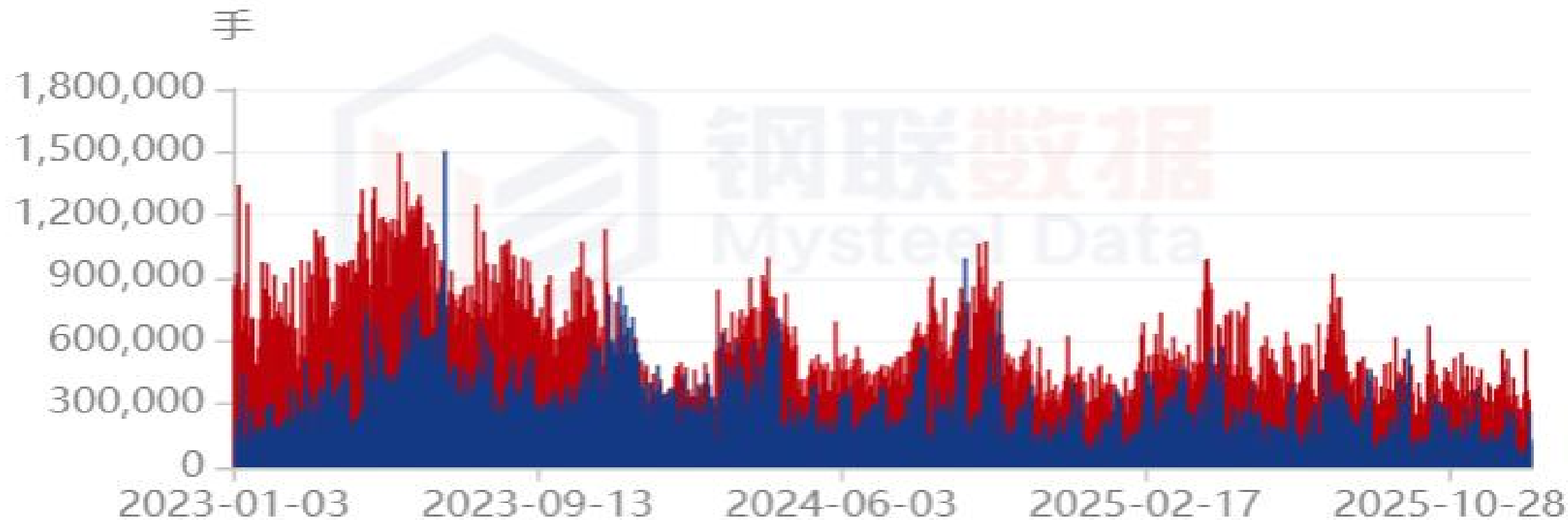
铁矿石消耗量

+ ⚠️ 📍 📈 📉 ⬇️ 🔍 ↺



铁矿石成交量

+ ⚠️ 📍 📈 📉 ⬇️ 🔍 ↺



■ DCE: 铁矿: 单边交易: 成交量 (日)

■ DCE: 铁矿: 期货期权合约:

◀ 1/2 ▶

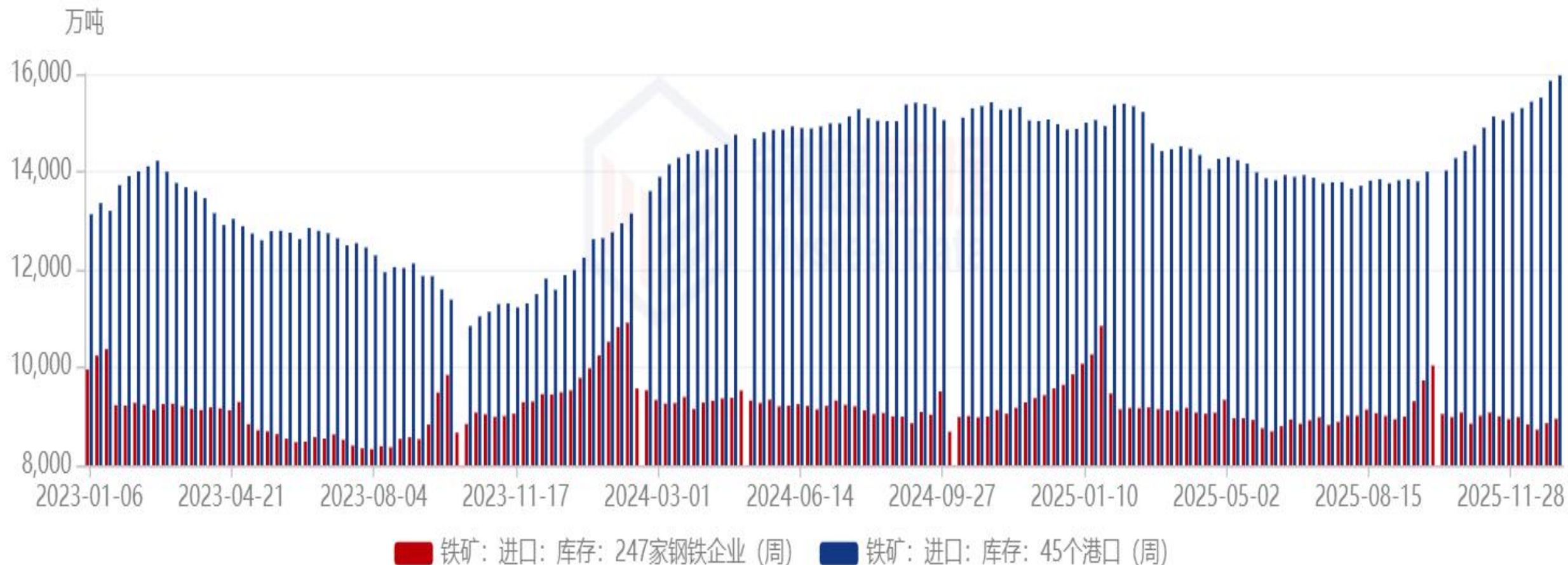
铁水产量

+ ⚠ 📍 📈 📉 ⬇ ⏏ ↺



中国铁矿石库存分析

+ ⚠ 📍 📈 📉 ⬇ 🔍 ↺

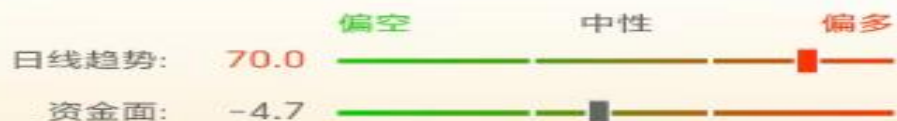


< 铁矿石(i) ▾
品种诊断 机构观点 盈利席位 主力资金

— AI品种诊断报告 —

看整体趋势，日线基本处在上升通道中，根据近年来行情周期的规律，当前可能处于行情开始阶段。

资金方面，主力没有明显的多空偏向。同时，资金流出幅度较大，主力关注度降低。



技术面 01-01 15:16:50

分钟趋势

5分钟线横盘整理，趋势大概率将持续

看整体趋势，5分钟线处在横盘阶段。根据近几日行情周期的规律，当前可能处于行情开始阶段。



< 铁矿石(i) ▾
品种诊断 机构观点 盈利席位 主力资金

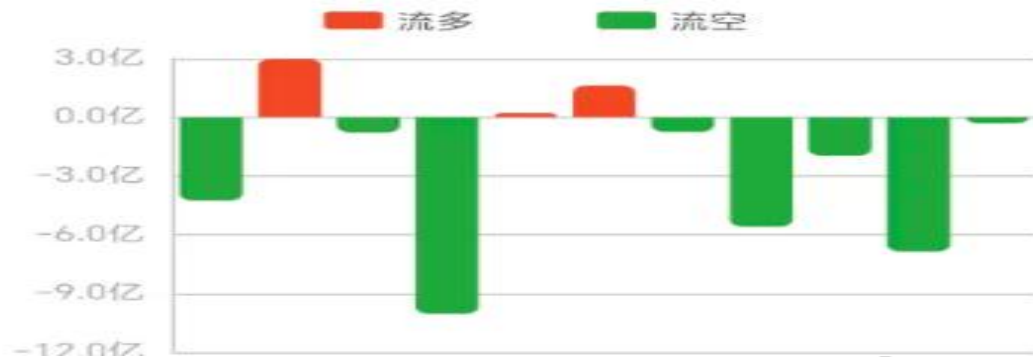
多空流向: -4.7 主力倾向不明显
资金能量: -75.4 资金流出幅度较大
多空分歧: 48.8 变盘风险较低

如何通过三大主力指标，对行情的方向、量级、风险快速做出判断？[查看>](#)

多空流向: -4.7 12-31 17:57 说明③

主力没有明显的多空偏向

- 铁矿石品种前20持仓今日流空3173万，AI评分为-4.7，在历史上属于多空偏向不明显。
- 流空已持续5日，但相比上日，流空幅度有所回落。





本报告的信息均来源于公开资料，我公司对这些信息的准确性、可靠性和完整性不作任何保证，也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。我们已力求报告内容的客观、公正，但文中的观点、结论和建议仅供参考，并不构成任何具体产品、业务的推介以及相关品种的操作依据和建议，投资者据此作出的任何投资决策自负盈亏，与本公司和作者无关。

本报告版权归长城期货所有，未经长城期货书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“长城期货”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。

交易咨询业务资格：广东证监许可〔2023〕1号
谭坚 从业资格：F03129048 投资咨询：Z0020299

长城期货股份有限公司提醒广大投资者：期市有风险，入市需谨慎！



长城期货
GREAT WALL FUTURES

谢谢

感谢您的观看

本报告中所有观点仅供参考，请务必阅读本报告倒数第二页的免责声明。