



撰写人：蔡跃辉
从业资格证号：F0251444
投资咨询从业证书号：Z0013101

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)	811.00	-16.00↓	I 主力合约持仓量(手)	685,337	-22498↓
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	76.5	+11.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	86068	-3800↓
	I 大商所仓单 (手)	2,200.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	112.25	-1.52↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	951	+51↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	929	+91↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	812	+19↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	118	+251↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	116.60	+2.10↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.28	-0.05↓
	进口成本预估值(元/吨)	977	+17↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,727.00	+59.50↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,584.00	+221.10↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,032.48	-18.51↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,538.98	+172.78↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,348.00	-204.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	+1.00↑
	全国126座矿山开工率(旬, %)	67.97	+0.15↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	79.50	-12.10↓
	BDI指数	1,080.00	-30.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.07	-0.20↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.39	+0.10↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.36	-0.73↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.77	-0.02↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,080	-31↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	55.23	+0.30↑	标的历史40日波动率(日, %)	42.19	+0.27↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.02	-0.17↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.81	+1.25↑
行业消息	1、8月21日-8月27日中国47港到港总量2584万吨，环比增加221.1万吨；中国45港到港总量2487万吨，环比增加249.5万吨；北方六港到港总量为1065.8万吨，环比增加22.0万吨。 2、8月21日-8月27日 本期Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2727.0万吨，环比增加59.5万吨。澳洲发运量1816.0万吨，环比减少23.3万吨，其中澳洲发往中国的量1521.0万吨，环比减少27.2万吨。巴西发运量911.1万吨，环比增加82.8万吨。					 更多资讯请关注！
观点总结	周一I2401合约减仓回落。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均出现增加，将提升铁矿石现货供应。贸易商报价积极性尚可，钢厂询盘一般，市场交投情绪较好。多地粗钢平控要求逐步落地，多家钢厂发布检修计划，钢厂利润收缩或向上挤压炉料价格。技术上，I2401合约1小时 MACD指标显示DIFF与 DEA向下调整。操作上建议，反弹择机短空，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！

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
王凯慧
期货从业资格号F03100511

王世霖
期货从业资格号F03118150

备注：I：铁矿石

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。