



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)	810.50	-20.50↓	I 主力合约持仓量(手)	493,312	-46239↓
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	88.5	+3.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	37486	+6375↑
	I 大商所仓单 (手)	3,000.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15: 00报价(美元/吨)	100	-3.90↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	913	-18↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	894	-16↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	773	-12↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	83	+5↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	106.95	-2.60↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.47	+0.03↑
	进口成本预估值(元/吨)	894	-19↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,665.70	+223.40↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,090.30	-390.40↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,451.96	-88.60↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,344.97	-57.44↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,552.00	-65.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	15.00	-1.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	68.57	+0.73↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	107.70	-2.70↓
	BDI指数	1,123.00	-27.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.09	-0.07↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.05	-0.21↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.14	-1.46↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.82	-1.34↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,111	+99↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	26.00	+1.55↑	标的历史40日波动率(日, %)	25.03	+0.85↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	22.69	-3.68↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	21.74	-2.49↓
行业消息	1、国际评级机构惠誉8月1日将美国长期外币发行人违约评级从AAA下调至AA+。惠誉表示，评级下调反映了未来三年美国财政预期恶化。 2、3日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2225.21万吨，环比上期降56.9万吨。烧结粉总日耗114.8万吨，增3.97万吨。库存消费比19.38，降1.21。					 更多资讯请关注！
观点总结	周四I2309合约减仓下行，进口铁矿石现货报价下调。贸易商报价积极性一般，投机需求较弱，钢厂询盘较少，现货市场交投情绪较为冷清。由于消费淡季，钢厂维持较低水平采购。惠誉将美国长期外币发行人违约评级从AAA下调至AA+，市场寻求避险，商品普跌。技术上，I2309合约1小时 MACD指标显示DIFF与 DEA向下调整。操作上建议，震荡偏空交易，注意风险控制。					 更多观点请咨询！
重点关注	国内铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率					

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