



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)	716.00	-3.50↓	I 主力合约持仓量(手)	648,875	+24527↑
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	99.5	+4.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	48074	+7735↑
	I 大商所仓单 (手)	2,400.00	-300.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	100.35	-0.69↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	899	-3↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	878	-2↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	762	+1↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	162	+1↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	104.10	-0.95↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.50	+0.01↑
	进口成本预估值(元/吨)	872	-5↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,280.70	-385.00↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	1,935.30	-155.00↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,290.36	-161.60↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,328.32	-16.65↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,347.60	-204.40↓	铁矿石可用天数(周, 天)	15.00	0.00
	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	1,145.00	+9.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.47	+0.08↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.525	+0.23↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.36	+1.22↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	90.05	+0.23↑
	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, %)	51.00	-0.51↓	标的历史40日波动率(日, %)	39.57	-0.67↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	30.03	+1.08↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.19	-1.56↓
行业消息	1、7月中国进口铁矿砂及其精矿9347.6万吨，较上月减少204.2万吨，环比下降2.1%；1-7月累计进口铁矿砂及其精矿66945.6万吨，同比增长6.9%。 2、7月31日-8月6日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2280.7万吨，环比减少385.0万吨。澳洲发运量1688.1万吨，环比减少166.5万吨，其中澳洲发往中国的量1335.9万吨，环比减少112.7万吨。巴西发运量592.7万吨，环比减少218.5万吨。					 更多资讯请关注！
观点总结	周二I2401合约重心下移，但相对抗跌，进口铁矿石现货报价下调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均出现下滑，将减少现货供应。但随着钢价下调，钢厂盈利情况承压收缩，采购步调仍以刚需补库为主，同时粗钢产量平控陆续落地执行，铁矿石远端需求回落预期较强。技术上，I2401合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上建议，反弹择机短空，注意风险控制。					 更多观点请咨询！
重点关注						