

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)	771.00	-1.00↓	主力合约持仓量(手)	449,577	+674↑
	I 9-1合约价差 (元/吨)	18	0.00	合约前20名净持仓(手)	4627	+393↑
	I 大商所仓单 (手)	2,500.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	101.1	-0.33↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	833	-3↓	青岛港60.8%麦克粉矿 (元/干吨)	823	-3↓
	京唐港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	696	-5↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	52	-2↓
	铁矿石62%普氏指数 (前一日, 美元/吨)	101.05	-0.75↓	江苏废钢/青岛港60.8%麦克粉矿	3.40	+0.06↑
	进口成本预估值(元/吨)	830	-6↓			
产业情况	全球铁矿石发运总量(周, 万吨)	3,406.60	+359.90↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,703.10	+131.50↑
	47港铁矿石库存量(周, 万吨)	14,381.57	+114.30↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,136.40	+123.06↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,462.00	-133.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	23.00	+5↑
	266座矿山日产量(周, 万吨)	41.18	+2.34↑	266座矿山开工率(周, %)	64.98	+3.02↑
	266座矿山铁精粉库存(周, 万吨)	34.60	-2.00↓	BDI指数	2,022.00	-22.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.53	-0.33↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.78	-0.26↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.57	-0.20↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	90.24	+0.17↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	7,966	-353↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	17.46	-1.33↓	标的历史40日波动率(日, %)	19.48	-0.05↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	18.70	-0.16↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	19.59	+0.78↑
行业消息	1、2025年08月11日-08月17日Mysteel全球铁矿石发运总量3406.6万吨, 环比增加359.9万吨。澳洲巴西铁矿发运总量2756.0万吨, 环比增加225.7万吨。 2、2025年08月11日-08月17日中国47港到港总量2703.1万吨, 环比增加131.5万吨; 中国45港到港总量2476.6万吨, 环比增加94.7万吨; 北方六港到港总量1252.5万吨, 环比增加49.5万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周二I2601合约弱势整理。宏观方面, 美国总统特朗普18日在白宫与到访的泽连斯基举行会晤后表示, 下一步将筹备与俄罗斯总统普京的美俄乌三方领导人会晤, 他期待取得好成果。供需情况, 本期澳巴铁矿石发运量和到港量增加, 同时国内港口库存继续提升; 钢厂高炉开工率高位运行, 铁水产量小幅上调, 日均产量维持240万吨上方。整体上, 关税扰动再度影响市场情绪, 黑色系承压回调。技术上, I2601合约1小时MACD指标 显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上, 反弹择机短空, 注意节奏和风险控制。					
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

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。