

撰写人：陈一兰 从业资格证号：F3010136 投资咨询从业证书号：Z0012698

| 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)                                                                                                                                                                                                                                | 720.50    | -8.00↓   | I 主力合约持仓量(手)          | 775,732  | -4483↓                                                                                            |
|      | I 1-5合约价差 (元/吨)                                                                                                                                                                                                                                | 41        | -2.50↓   | I 合约前20名净持仓(手)        | 9547     | +789↑                                                                                             |
|      | I 大商所仓单 (手)                                                                                                                                                                                                                                    | 3,900.00  | +400.00↑ |                       |          |                                                                                                   |
|      | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)                                                                                                                                                                                                                      | 101       | -2.30↓   |                       |          |                                                                                                   |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)                                                                                                                                                                                                                            | 818       | -13↓     | 青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)     | 803      | -11↓                                                                                              |
|      | 青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)                                                                                                                                                                                                                            | 712       | -11↓     | I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约) | 83       | -3↓                                                                                               |
|      | 铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)                                                                                                                                                                                                                              | 104.25    | +2.30↑   | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)   | 4.10     | +0.09↑                                                                                            |
|      | 进口成本预估值(元/吨)                                                                                                                                                                                                                                   | 849       | +20↑     |                       |          |                                                                                                   |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)                                                                                                                                                                                                                              | 2,374.10  | -226.00↓ | 中国45港到港总量(周, 万吨)      | 2,347.20 | +453.60↑                                                                                          |
|      | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)                                                                                                                                                                                                                             | 13,688.98 | -347.48↓ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)     | 9,714.10 | -25.90↓                                                                                           |
|      | 铁矿石进口量(月, 万吨)                                                                                                                                                                                                                                  | 9,620.80  | +496.80↑ | 铁矿石可用天数(周, 天)         | 19.00    | -1.00↓                                                                                            |
|      | 全国126座矿山开工率(旬, %)                                                                                                                                                                                                                              | 64.39     | -0.87↓   | 全国126座矿山库存量(旬, 万吨)    | 281.65   | -3.93↓                                                                                            |
|      | BDI指数                                                                                                                                                                                                                                          | 1,408.00  | +152.00↑ |                       |          |                                                                                                   |
|      | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)                                                                                                                                                                                                                           | 18.99     | +0.05↑   | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)     | 8.15     | +0.03↑                                                                                            |
| 下游情况 | 247家钢厂高炉开工率(周, %)                                                                                                                                                                                                                              | 81.99     | +1.14↑   | 247家钢厂高炉产能利用率(周, %)   | 87.56    | +0.73↑                                                                                            |
|      | 国内粗钢产量(月, 万吨)                                                                                                                                                                                                                                  | 8,143     | -930↓    |                       |          |                                                                                                   |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日, %)                                                                                                                                                                                                                               | 41.56     | +0.10↑   | 标的历史40日波动率(日, %)      | 45.32    | +0.61↑                                                                                            |
|      | 平值看涨期权隐含波动率(日, %)                                                                                                                                                                                                                              | 34.95     | -0.51↓   | 平值看跌期权隐含波动率(日, %)     | 34.60    | -1.67↓                                                                                            |
| 行业消息 | 1、9月5日-9月11日中国47港到港总量2347.2万吨，环比增加453.6万吨；中国45港到港总量2238.1万吨，环比增加413.6万吨；北方六港到港总量为1027.7万吨，环比减少76.7万吨。<br>2、9月5日-9月11日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2374.1万吨，环比减少226.0万吨。澳洲发运量1742.1万吨，环比增加49.5万吨，其中澳洲发往中国的量1529.6万吨，环比增加55.7万吨。巴西发运量632.0万吨，环比减少275.5万吨。 |           |          |                       |          | <br>更多资讯请关注！   |
| 观点总结 | 周三I2301合约低开整理，进口铁矿石现货报价下调。美国8月CPI超预期，美联储9月加息75个基点预期升温，拖累大宗商品价格。另外，本期铁矿石到港量明显回升，将增加现货供应；需求端，钢厂高炉开工率持续提升将增加铁矿石现货需求。短线行情或有反复，注意操作节奏。技术上，I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA高位回调。操作上建议，日内短线交易，注意风险控制。                                                       |           |          |                       |          | <br>更多观点请咨询！ |
| 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