

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	主力合约收盘价(元/吨)	836.50	-17.00↓	主力合约持仓量(手)	720,725	-4653↓
	1-5合约价差(元/吨)	33	-3.50↓	合约前20名净持仓(手)	68443	+7180↑
	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)	114.6	-1.65↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	974	0.00	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	959	-6↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	819	0.00	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	111	-11↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	119.50	+0.75↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	2.96	+0.02↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,002	+6↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,762.90	+35.90↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,010.90	-573.20↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,126.76	+94.28↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,572.69	+33.71↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,641.50	+1293.50↑	铁矿石可用天数(周, 天)	17.00	+1.00↑
	全国186座矿山开工率(旬, %)	64.97	+0.21↑	全国186座矿山库存量(旬, 万吨)	111.30	-15.90↓
下游情况	BDI指数	1,081.00	+18.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	7.88	+0.09↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	18.81	-0.13↓			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.09	+0.73↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	92.27	+0.50↑
期权市场	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,080	-31↓			
	标的历历史20日波动率(日, %)	28.62	+0.93↑	标的历历史40日波动率(日, %)	42.12	+0.31↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	29.32	+6.34↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	28.44	+7.96↑
行业消息	1、8月中国进口铁矿砂及其精矿10641.5万吨,较上月增加1293.9万吨,环比增长13.8%;1-8月累计进口铁矿砂及其精矿77565.8万吨,同比增长7.4%。国内铁矿石进口量再度突破1亿吨,现货供应维持相对宽松。 2、按美元计价,8月份中国外贸进出口5013.8亿美元。其中,出口2848.7亿美元,同比-8.8%;进口2165.1亿美元,同比-7.3%;贸易顺差683.6亿美元。外贸降幅缩窄,进出口修复均好于预期,但内外需疲弱状况未曾改变。					
观点总结	周四I2401合约减仓下行,进口铁矿石现货报价下调。8月中国进口铁矿砂及其精矿10641.5万吨,较上月增加1293.9万吨,环比增长13.8%,国内铁矿石进口量再度突破1亿吨,现货供应维持相对宽松。贸易商报盘积极性一般,报价随行就市;钢厂方面采购谨慎,按需补库为主,随着钢厂利润收缩将挤压矿价,同时对高品需求愈加减弱。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	周五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!

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444
 助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823
 王世霖 期货从业资格号F03118150

备注: I: 铁矿石

期货投资咨询从业证书号Z0013101

王凯慧 期货从业资格号F03100511

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。



更多资讯请关注!

