

| 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) | 851.50 | +24.00↑ | I 主力合约持仓量(手) | 738,946 | +29569↑ |
| | I 1-5合约价差 (元/吨) | 37 | 0.00 | I 合约前20名净持仓(手) | 90619 | +11357↑ |
| | I 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) | 117.65 | +4.32↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨) | 955 | 0.00 | 青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨) | 957 | +12↑ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨) | 798 | 0.00 | I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约) | 118 | +12↑ |
| | 铁矿石62%普氏指数 (美元/吨) | 116.80 | -0.90↓ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 2.95 | -0.04↓ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 982 | -7↓ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,519.20 | -243.70↓ | 中国47港到港总量(周, 万吨) | 2,832.70 | +821.80↑ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 11,867.87 | -258.89↓ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 8,531.89 | -40.80↓ |
| | 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, %) | 65.42 | +0.45↑ | 全国186座矿山库存量(旬, 万吨) | 104.39 | -6.91↓ |
| | BDI指数 | 1,186.00 | +45.00↑ | | | |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 0.00 | -18.95↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 0 | -8.27↓ |
| 下游情况 | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 84.39 | +0.30↑ | 247家钢厂高炉产能利用率(周, %) | 92.76 | +0.49↑ |
| | 国内粗钢产量(月, 万吨) | 9,080 | -31↓ | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日, %) | 27.16 | -0.49↓ | 标的历史40日波动率(日, %) | 42.10 | +0.34↑ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 28.47 | +2.51↑ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 28.33 | +2.46↑ |
| 行业消息 | 1、9月4日-9月10日本期Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2519.2万吨，环比减少243.7万吨。澳洲发运量1838.4万吨，环比减少48.5万吨，其中澳洲发往中国的量1520.3万吨，环比增加52.9万吨。巴西发运量680.8万吨，环比减少195.2万吨。 2、9月4日-9月10日中国47港到港总量2832.7万吨，环比增加821.8万吨；中国45港到港总量2702.9万吨，环比增加724.2万吨；北方六港到港总量为1242.5万吨，环比增加241.7万吨。 | | | | |  <div>更多资讯请关注！</div> |
| 观点总结 | 周一I2401合约增仓上行，进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石到港量增加，将提升现货供应。贸易商报价积极性尚可，报价随行就市为主，部分贸易商报价较为坚挺，部分钢厂刚需补库为主，多数按需采购。日前，两部门加强铁矿石市场监管，市场情绪一度受到影响，只是钢厂高炉开工率维持高位对铁矿石仍有需求支撑，短线行情或陷入区间宽幅整理。技术上，I2401合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位反弹。操作上建议，830-860区间低买高抛，止损10元/吨。 | | | | |  |
| 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！

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

助理研究员：李秋荣 期货从业资格号F03101823

王凯慧 期货从业资格号F03100511

王世霖 期货从业资格号F03118150

备注：I：铁矿石

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。