

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 | +13.00↑ | I 主力合约持仓量(手) | 667,848 | +386↑ |
| | I 9-1合约价差 (元/吨) | 69 | -11.50↓ | I 合约前20名净持仓(手) | 7138 | +4857↑ |
| | I 大商所仓单 (手) | 2,300.00 | -100.00↓ | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨) | 105.55 | -0.48↓ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨) | 829 | -18↓ | 青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨) | 814 | -12↓ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨) | 696 | -11↓ | I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约) | 94 | -25↓ |
| | 铁矿石62%普氏指数 (美元/吨) | 104.40 | -4.45↓ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 4.03 | +0.06↑ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 834 | -30↓ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,397.90 | -213.50↓ | 中国45港到港总量(周, 万吨) | 2,274.70 | -221.50↓ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 13,886.16 | +182.18↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 9,920.73 | +130.60↑ |
| | 铁矿石进口量(月, 万吨) | 9,124.40 | +227.40↑ | 铁矿石可用天数(周, 天) | 21.00 | -4.00↓ |
| | 全国126座矿山开工率(旬, %) | 64.81 | +0.64↑ | 全国126座矿山库存量(旬, 万吨) | 276.82 | +3.03↑ |
| | BDI指数 | 1,404.00 | -73.00↓ | | | |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 20.55 | -0.22↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 8.02 | -0.07↓ |
| | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 76.24 | +3.54↑ | 247家钢厂高炉产能利用率(周, %) | 81.22 | +1.62↑ |
| 期权市场 | 国内粗钢产量(月, 万吨) | 8,143 | -930↓ | | | |
| | 标的历史20日波动率(日, %) | 48.54 | -1.55↓ | 标的历史40日波动率(日, %) | 57.37 | +0.19↑ |
| 行业消息 | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 42.17 | -1.08↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 42.33 | -1.05↓ |
| | <p>1、8月8日-8月14日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2397.9万吨, 环比减少213.5万吨。澳洲发运量1761.5万吨, 环比减少144.3万吨, 其中澳洲发往中国的量1550.8万吨, 环比减少17.7万吨。巴西发运量636.4万吨, 环比减少69.2万吨。</p> <p>2、8月8日-8月14日中国47港到港总量2274.7万吨, 环比减少221.5万吨; 中国45港到港总量2113.2万吨, 环比减少307.5万吨; 北方六港到港总量为1215.6万吨, 环比减少301.3万吨。</p> | | | | | |
| 观点总结 | <p>周二I2301合约低开高走, 进口铁矿石现货报价平稳。本期澳巴铁矿石发运总量及到港量明显下滑, 支撑矿价走高。但当前港口库存持续累库, 供需宽松格局延续, 而钢厂利润逐渐修复, 高炉复产有所增加, 铁水产量有望延续涨势。远月合约行情波动或震荡偏强。技术上, I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位整理。操作上建议, 695上方偏多交易, 注意风险控制。</p> | | | | | |
| 重点关注 | | | | | | |



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!

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