

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 | 主力合约收盘价(元/吨) | 696.00 | -9.50↓ | 主力合约持仓量(手) | 742,730 | -24216↓ |
| | I 1-5合约价差(元/吨) | 39.5 | +1.00↑ | 合约前20名净持仓(手) | -8605 | -877↓ |
| | 大商所仓单(手) | 4,900.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨) | 96.35 | -0.70↓ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 821 | -5↓ | 青岛港61%麦克粉矿(元/干吨) | 809 | -8↓ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 726 | -2↓ | 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 113 | +2↑ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 97.70 | -0.75↓ | 江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值) | 4.03 | +0.04↑ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 802 | -5↓ | | | |
| 产业情况 | 澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨) | 2,541.80 | +167.70↑ | 中国45港到港总量(周, 万吨) | 2,519.20 | +172.00↑ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周, 万吨) | 13,718.92 | +29.94↑ | 样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨) | 9,783.88 | +69.78↑ |
| | 铁矿石进口量(月, 万吨) | 9,621.00 | +497.00↑ | 铁矿石可用天数(周, 天) | 19.00 | 0.00 |
| | 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 | 1,553.00 | -59.00↓ | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 8.85 | -0.94↓ |
| 下游情况 | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 21.92 | -0.39↓ | | | |
| | 247家钢厂高炉开工率(周, %) | 82.41 | +0.42↑ | 247家钢厂高炉产能用率(周, %) | 88.32 | +0.76↑ |
| | 国内粗钢产量(月, 万吨) | 8,387 | +244↑ | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日, %) | 36.40 | -0.45↓ | 标的历史40日波动率(日, %) | 42.63 | -1.06↓ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日, %) | 37.22 | +0.14↑ | 平值看跌期权隐含波动率(日, %) | 36.93 | +0.83↑ |
| 行业消息 | 1、9月12日-9月18日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2541.8万吨，环比增加167.7万吨。澳洲发运量1869.1万吨，环比增加127.0万吨，其中澳洲发往中国的量1527.4万吨，环比减少2.3万吨。巴西发运量672.6万吨，环比增加40.7万吨。 2、9月12日-9月18日中国47港到港总量2519.2万吨，环比增加172.0万吨；中国45港到港总量2359.6万吨，环比增加121.6万吨；北方六港到港总量为1417.1万吨，环比增加389.4万吨。 | | | | | |
| | | | | | | |
| 观点总结 | 周二I2301合约减仓下行，进口铁矿石现货报价下调。本期澳洲铁矿石发运总量及到港量均出现回升，将提升现货供应，同时美联储9月议息会议临近，大宗商品价格普遍承压。目前钢厂依旧维持低库存运行，保持着少量多次的采购频率，钢厂现货补库尚未完全开启，对矿价构成压制。技术上，I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议，短线震荡偏空交易，注意风险控制。 | | | | | |
| | | | | | | |
| 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



更多资讯请关注！



更多观点请咨询！