

撰写人: 蔡跃辉 从业资格证号: F0251444 投资咨询从业证书号: Z0013101

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)	777.00	+5.50↑	I主力合约持仓量(手)	663,261	-24791↓
	I9-1合约价差(元/吨)	93	+2.00↑	I合约前20名净持仓(手)	74256	+4647↑
	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)	107.65	+0.80↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	915	+3↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	895	+3↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	766	+4↑	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	118	-2↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	109.35	+0.55↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.37	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	920	+4↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,579.00	+298.30↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	3,283.20	+1347.90↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,050.99	+105.08↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,366.20	-23.39↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,348.00	-204.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	15.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	67.82	-0.75↓	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	91.60	-16.10↓
	BDI指数	1,237.00	-10.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	21.23	-0.22↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.84	-0.14↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.09	+0.29↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.79	+0.76↑
	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, %)	53.48	+0.16↑	标的历史40日波动率(日, %)	41.39	+0.05↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	28.47	+2.91↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.27	+2.01↑
行业消息	1、8月14日-8月20日中国47港到港总量2362.9万吨, 环比减少920.3万吨; 中国45港到港总量2237.5万吨, 环比减少943.3万吨; 北方六港到港总量为1043.8万吨, 环比减少652.8万吨。 2、8月14日-8月20日本期Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2667.6万吨, 环比增加88.5万吨。澳洲发运量1839.3万吨, 环比增加65.1万吨, 其中澳洲发往中国的量1548.2万吨, 环比减少3.1万吨。巴西发运量828.3万吨, 环比增加23.4万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2401合约减仓反弹, 进口铁矿石现货报价上调。随着天气因素影响减少, 铁矿石现货供应将逐步增加。需求端, 钢厂高炉开工率及产能利用率小幅走高, 但多地粗钢平控要求逐步落地, 需求量或下滑。最后, 国内宏观面将维持稳增长, 扩内需, 利好政策对黑色系仍有支撑。技术上, I2401合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA高位运行。操作上建议, 震荡偏多交易, 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