



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)	817.00	+11.50↑	I 主力合约持仓量(手)	672,098	-4312↓
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	86.5	-8.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	79379	-3633↓
	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)	112.75	+2.07↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	963	+34↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	937	+29↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	796	+27↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	120	+17↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	113.30	+2.95↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.22	-0.10↓
	进口成本预估值(元/吨)	952	+24↑			
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	1,194.00	-29.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.25	-0.62↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.73	-0.01↓
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, %)	55.23	+0.31↑	标的历史40日波动率(日, %)	42.25	+0.71↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	29.31	+0.22↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	30.72	+2.20↑
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、Mysteel统计中国45港进口铁矿石库存总量12001.12万吨，环比上周一增加20万吨，47港库存总量12616.12万吨，环比增加31万吨。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周三I2401合约冲高回调，进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石到港量明显减少，将降低铁矿石现货供应。贸易商报盘积极性一般，报价随行就市，临近月底交货，部分贸易商有采购需求；钢厂方面采购谨慎，按需补库为主。虽然，多地粗钢平控要求逐步落地，多家钢厂发布检修计划，但当前钢高炉开工率维持在较高水平，同时铁矿石远月合约贴水现货较深，支撑期价上行。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						