

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)	703.50	-9.50↓	I主力合约持仓量(手)	486,831	+16444↑
	I1-5合约价差(元/吨)	9.5	-0.50↓	合约前20名净持仓(手)	-27916	-5896↓
	I大商所仓单(手)	2,100.00	-300.00↓			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	93.75	-2.15↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	787	-23↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	763	-24↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	647	-17↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	60	-14↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	95.25	-3.00↓	铁废价差	-18.00	-24.00↓
	进口成本预估值(元/吨)	798	-24↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	2,443.30	-92.60↓	中国45港到港总量(周,万吨)	2,354.70	-256.00↓
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	15,040.94	-52.60↓	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,045.87	-76.81↓
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,281.30	+520.30↑	铁矿石可用天数(周,天)	18.00	-5↓
	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	37.38	-1.64↓	全国186座矿山开工率(旬,%)	59.40	-2.84↓
	全国186座矿山库存(旬,万吨)	32.95	-15.15↓	BDI指数	1,728.00	+58.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	25.55	+0.41↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.03	+0.66↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	80.19	-1.07↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	87.00	-1.85↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	8,294	-867↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	231.65	-4.90↓
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	25.40	-0.43↓	标的历史40日波动率(日,%)	26.54	+0.09↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	31.62	+0.35↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	31.32	+0.15↑
行业消息	1.网传《唐山市2024年粗钢产量调控方案》要求基于2023年目标压减。2024年1-7月份唐山粗钢总量预估为7924万吨,与去年同期相比降0.99%。假设传闻落地,若平均按照5%压减比例计算,剩下5个月粗钢总量不得超过约3618万吨,日均应控制在23.65万吨,减产压力大。					
	2.8月14日,新西兰联储将利率从5.5%降至5.25%,为2020年3月以来首次降息。此前新西兰联储连续八次维持利率不变。					
观点总结	8月15日铁矿2501收盘703.5,下跌2.09%。宏观面,网传《唐山市2024年粗钢产量调控方案》要求基于2023年目标压减,后续减产压力大。供需方面,库存高位,下游成材价格维持弱势,铁水有减量预期,原料负反馈。技术上,日K线在10日和20日均线下方,1H周期K线在10日和20日均线下方,操作上,最后一个交易日空单建议止盈,日内震荡思路对待,请投资者注意风险控制。					
重点关注						



更多资讯请关注!



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

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  
徐玉花 期货从业资格号F03132080

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。