



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)	719.50	-6.00↓	I 主力合约持仓量(手)	624,348	+349461
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	95	+3.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	40339	-3822↓
	I 大商所仓单 (手)	2,700.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	100.75	-0.96↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	902	-11↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	880	-17↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	761	-19↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	160	-11↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	105.05	+1.30↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.49	+0.03↑
	进口成本预估值(元/吨)	877	+10↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,280.70	-385.00↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	1,935.30	-155.00↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,290.36	-161.60↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,328.32	-16.65↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,552.00	-65.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	15.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	68.57	+0.73↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	107.70	-2.70↓
	BDI指数	1,136.00	+8.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.39	+0.31↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.295	+0.02↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.36	+1.22↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	90.05	+0.23↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,111	+99↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	51.51	+26.36↑	标的历史40日波动率(日, %)	40.24	+15.16↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	28.95	+0.53↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	30.75	+5.72↑
行业消息	1、7月31日-8月6日中国47港到港总量1935.3万吨，环比减少155.0万吨；中国45港到港总量1867.4万吨，环比减少166.5万吨；北方六港到港总量为951.1万吨，环比减少16.7万吨。 2、7月31日-8月6日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2280.7万吨，环比减少385.0万吨。澳洲发运量1688.1万吨，环比减少166.5万吨，其中澳洲发往中国的量1335.9万吨，环比减少112.7万吨。巴西发运量592.7万吨，环比减少218.5万吨。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周一I2401合约震荡偏弱，进口铁矿石现货报价下调。贸易商整体报盘较为积极，出货意愿尚可；但区域内钢厂盈利情况承压收缩，采购步调仍以刚需补库为主，但随着粗钢产量平控陆续落地执行，铁矿石远端需求回落预期较强。技术上，I2401合约1小时 MACD指标显示DIFF与 DEA运行于0轴下方。操作上建议，反弹择机短空，注意风险控制。					 <div>更多观点请咨询！</div>
重点关注						