

| 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) | 776.50 | -2.50↓ | I主力合约持仓量(手) | 367,597 | +14407↑ |
| | I1-5合约价差(元/吨) | 14.5 | 0.00 | 合约前20名净持仓(手) | -41026 | -2045↓ |
| | I大商所仓单(手) | 2,700.00 | 0.00 | | | |
| | 新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨) | 104.7 | +2.05↑ | | | |
| 现货市场 | 青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨) | 850 | +15↑ | 青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨) | 826 | +15↑ |
| | 青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨) | 697 | +14↑ | I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约) | 50 | +18↑ |
| | 铁矿石62%普氏指数(美元/吨) | 103.55 | +1.25↑ | 铁废价差 | -70.00 | -15.00↓ |
| | 进口成本预估值(元/吨) | 865 | +10↑ | | | |
| 产业情况 | 澳巴铁矿石发运量(周,万吨) | 2,535.90 | +48.30↑ | 中国45港到港总量(周,万吨) | 2,610.70 | +788.70↑ |
| | 45港铁矿石港口库存量(周,万吨) | 15,093.54 | -182.09↓ | 样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨) | 9,122.68 | -82.22↓ |
| | 铁矿石进口量(月,万吨) | 9,761.00 | -442.00↓ | 铁矿石可用天数(周,天) | 17.00 | 0.00 |
| | 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 | 1,668.00 | -40.00↓ |
| | 铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨) | 23.69 | -0.18↓ | 铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨) | 9.485 | +0.15↑ |
| 下游情况 | 247家钢厂高炉开工率(周,%) | 81.26 | -1.05↓ | 247家钢厂高炉产能利用率(周,%) | 88.85 | -0.74↓ |
| | 国内粗钢产量(月,万吨) | 9,161 | -125↓ | 日均铁水产量(247家)(周,万吨) | 236.55 | -3.01↓ |
| | | | | | | |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日,%) | 25.32 | -1.05↓ | 标的历史40日波动率(日,%) | 26.57 | -0.01↓ |
| | 平值看涨期权隐含波动率(日,%) | 29.47 | +0.99↑ | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 30.51 | +0.78↑ |
| 行业消息 | 5.美国7月非农就业人数增加11.4万人,预估为增加17.5万人,前值为增加20.6万人。 6.本期Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2535.9万吨,环比增加48.3万吨。澳洲发运量1810.2万吨,环比增加242.0万吨,其中澳洲发往中国的量1520.2万吨,环比增加385.5万吨。巴西发运量725.7万吨,环比减少193.7万吨。澳洲发货总量环比增加15.4%,巴西发货总量环比降低21.1%,澳洲巴西发运总量环比增加1.9%,发运季节性平稳波动。 | | | | | |
| | 8月5日铁矿2501收盘776.5,上涨1.97%。宏观面,美国非农数据爆冷,市场认为9月大概率降息50个基点。供需方面,铁矿港口库存同期高位,本期到港量环比大幅提升43.3%,需求端,本期铁水236.62万吨,高位有所回落。驱动方面,成材螺纹供应降幅大于需求降幅,价格低位有所修复,铁矿跟随成材价格波动。技术上,1H周期K线在10日和20日均线上方,操作上,建议震荡偏多思路对待,请投资者注意风险控制。 | | | | | |
| 观点总结 | | | | | | |
| 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

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。