

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)	763.00	-13.50↓	I主力合约持仓量(手)	372,750	+5153↑
	I1-5合约价差(元/吨)	13	-1.50↓	合约前20名净持仓(手)	-39951	+1075↑
	I大商所仓单(手)	2,600.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	103	-1.70↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	860	+10↑	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	836	+10↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	708	+11↑	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	73	+23↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	104.10	+0.55↑	废铁价差	-24.00	+33.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	869	+4↑			
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	1,677.00	+2.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	23.67	+0.05↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.735	-0.09↓
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,%)	25.30	-0.02↓	标的历史40日波动率(日,%)	24.99	-1.58↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	30.77	+1.30↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	30.76	+0.25↑
行业消息	1.8月6日,美联储戴利表示,过去几个月经济一直在放缓;对在即将召开的9月会议上降息持开放态度。 2.中国矿产资源集团总经理、党组副书记郭斌:我国铁矿石真实需求下降、投机性需求上升。上半年,我国铁矿石消耗7.24亿吨,同比减少约3000万吨。然而,我国铁矿石进口量却上升,上半年净进口5.99亿吨,同比增长6.1%,除去1.5亿吨国产矿供给,国内生产性需求进口应是5.7亿吨,多进口的3000万吨变成了港口库存,且港口库存增量90%来自于贸易矿。					
	8月6日铁矿2501收盘763,下跌1.42%。宏观面,文华商品指数收跌1.5%,大宗商品普跌,市场情绪偏空,市场交易美联储9月降息大概率落地。供需方面,铁矿港口库存同期高位,本期到港量环比大幅增加43.3%,需求端,铁水有减量预期。技术上,1H周期K线在10日和20日均线下方,支撑位置关注748,操作上,建议震荡思路对待,请投资者注意风险控制。					
观点总结						
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。