

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)	729.50	-19.50↓	I主力合约持仓量(手)	431,078	+42167↑
	I1-5合约价差(元/吨)	10.5	-1.50↓	合约前20名净持仓(手)	-37388	-2793↓
	I大商所仓单(手)	2,600.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	99.2	-1.85↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	830	-13↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	805	-13↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	678	-12↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	76	+6↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	100.60	-1.70↓	铁废价差	-33.00	-24.00↓
	进口成本预估值(元/吨)	842	-13↓			
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)	10,281.30	+520.30↑	铁矿石可用天数(周,天)	23.00	+6↑
	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	1,698.00	+13.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.32	+0.35↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.885	+0.17↑
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,%)	24.37	-0.28↓	标的历史40日波动率(日,%)	25.87	+0.58↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	29.94	+0.20↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	29.82	-0.49↓
行业消息	1.美东时间周二,纽约联邦储备银行公布了一份关于2024年第二季度家庭债务和信贷的报告。该报告发现,美国家庭的总债务增加了1090亿美元,达到17.80万亿美元的创纪录水平。					
	2.Mysteel建筑企业调研数据显示,2024年7月实际钢材采购量606万吨,月环比减少4.5%;8月份计划钢材采购量646万吨,根据7月份实际采购量、商家计划采购量以及当前市场表现来预估,实际采购量月环比预计增加4%左右。					
观点总结	8月8日铁矿2501收盘729.5,下跌3.63%。宏观面,8月7日,日本央行副行长内田真一公开发出强烈鸽派信号,以稳定市场信心。他表示,在市场不稳定时,日本央行不会加息。供需方面,港口库存同期高位,本期到港量环比大幅提升43.3%,且下游成材在新标加价30元/吨情况下,工地优先采购旧国标螺纹,成材价格现实维持弱势,同时铁水有减量预期。技术上,1H周期K线在10日和20日均线下方,支撑位置关注704,操作上,建议震荡偏空思路对待,请投资者注意风险控制。					
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。