

撰写人：陈一兰 从业资格证号：F3010136 投资咨询从业证书号：Z0012698

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)	684.00	-36.50↓	I 主力合约持仓量(手)	684,691	+16843↑
	I 9-1合约价差 (元/吨)	76	+7.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	-4292	-11430↓
	I 大商所仓单 (手)	2,300.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	102	-3.63↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	823	-7↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	810	-4↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	705	+10↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	126	+32↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	104.05	-0.35↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	4.09	+0.06↑
	进口成本预估值(元/吨)	833	-1↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,397.90	-213.50↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,274.70	-221.50↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,886.16	+182.18↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,920.73	+130.60↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,124.40	+227.40↑	铁矿石可用天数(周, 天)	21.00	-4.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	64.81	+0.64↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	276.82	+3.03↑
	BDI指数	1,387.00	-17.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.10	-0.21↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.5	-0.06↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	76.24	+3.54↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	81.22	+1.62↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,143	-930↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	48.54	-3.62↓	标的历史40日波动率(日, %)	57.37	+0.35↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	42.17	-2.90↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	42.33	-0.19↓
行业消息	1、上周，澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1143.70万吨，环比增加71.10万吨，处于今年的平均水平。 2、Mysteel统计7月全国332家铁矿山企业铁精粉产量为2295.5，环比减9.4，减幅0.4%；累计同比减442.9，降幅2.8%；同期统计，全国186家矿山企业产能利用率为64.36%，环比减0.08%。（单位：万吨）					 更多资讯请关注！
观点总结	周三I2301合约增仓下行，进口铁矿石现货报价下调。本期澳巴铁矿石发运总量及到港量明显下滑，但当前港口库存持续累库，供需宽松格局延续，而钢价走弱将对矿价构成较大压力。钢厂对铁矿石采购仍较为谨慎，多数维持低库存生产，按需采购为主。技术上，I2301合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下运行。操作上建议，日内震荡偏空交易，注意风险控制。					 更多观点请咨询！
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