

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)	734.50	+0.50↑	I主力合约持仓量(手)	444,062	+2537↑
	I1-5合约价差(元/吨)	12	+1.00↑	合约前20名净持仓(手)	-22843	-3349↓
	I大商所仓单(手)	2,200.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	98.95	-0.50↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	838	+10↑	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	814	+12↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	689	+10↑	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	80	+11↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	98.85	-0.45↓	铁废价差	-24.00	+23.00↑
	进口成本预估值(元/吨)	828	-3↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	2,443.30	-92.60↓	中国45港到港总量(周,万吨)	2,354.70	-256.00↓
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	15,040.94	-52.60↓	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	9,045.87	-76.81↓
	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	1,655.00	-15.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	24.73	+0.03↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.038	+0.16↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	80.19	-1.07↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	87.00	-1.85↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	9,161	-125↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	231.65	-4.90↓
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	25.15	+0.02↑	标的历史40日波动率(日,%)	25.65	-0.16↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	31.01	+1.27↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	30.63	+0.32↑
行业消息	1.8月5日-8月11日,中国47港铁矿石到港总量2429.3万吨,环比减少375.8万吨;中国45港铁矿石到港总量2354.7万吨,环比减少256.0万吨。					
	2.8月5日-8月11日,澳巴铁矿发运总量2443.3万吨,环比减少92.6万吨。澳洲发运量1639.0万吨,环比减少171.3万吨。					
	3.上周(8月5日-8月11日),10个重点城市新建商品房成交(签约)面积总计153.4万平方米,环比下降21%,同比下降9.8%。					
观点总结	8月13日铁矿2501收盘734.5,涨跌0.00%。宏观面,美国政府在7月份录得了规模高达2440亿美元的财政赤字,创下了历史同期的第二高纪录。供需方面,港口库存同期高位,本期到港量环比回落,下游成材价格维持弱势,同时铁水有减量预期,原料负反馈。驱动方面,焦炭有进一步的提降预期,利空铁矿。技术上,日K线在10日和20日均线下方,1H周期K线在10日和20日均线下方,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					



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。