

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)	703.50	-20.00↓	I主力合约持仓量(手)	536,814	+11863↑
	I1-5合约价差(元/吨)	13.5	0.00	合约前20名净持仓(手)	-22037	+6352↑
	I大商所仓单(手)	2,500.00	+100.00↑			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	94.4	-2.65↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	771	-27↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	753	-28↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	642	-26↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	50	-8↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	96.15	-4.10↓	铁废价差	-6.00	-28.00↓
	进口成本预估值(元/吨)	803	-32↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运量(周,万吨)	2,895.10	+284.90↑	中国47港到港总量(周,万吨)	2,399.00	+272.50↑
	47港铁矿石港口库存量(周,万吨)	15,368.11	+332.33↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	8,996.47	-3.59↓
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,281.00	+520.00↑	铁矿石可用天数(周,天)	18.00	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	1,721.00	+105.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	26.46	+0.09↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.985	+0.48↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周,%)	76.39	-1.06↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	82.94	-1.34↓
	国内粗钢产量(月,万吨)	8,294	-867↓	日均铁水产量(247家)(周,万吨)	220.83	-3.58↓
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	35.45	+3.72↑	标的历史40日波动率(日,%)	30.40	+1.53↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	30.73	+2.53↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	30.18	+1.63↑
行业消息	1.据Mysteel统计,38家上市煤企公布2024年上半年业绩,合计营业收入7640.36亿元,合计净利润885.32亿元。 2.2024年8月26日-9月1日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2895.1万吨,环比增加284.9万吨,年同比增加12.0%。澳洲发运量1836.1万吨,环比减少12.1万吨,其中澳洲发往中国的量1451.6万吨,环比减少99.6万吨,同比增加2.0%。巴西发运量1059.0万吨,环比增加297.0万吨,同比增加34.6%。巴西发运量大幅增加至历史新高。					 更多资讯请关注!
观点总结	9月3日铁矿2501收盘703.5,下跌4.74%,昨日青岛港PB粉矿61.5%报717元/吨,下跌29元/吨。宏观面,唐山调坯型钢厂于8月30日开始落实环保二级预警,但据Mysteel调研了解,在此次环保限产开启前多数型钢厂已因下游需求状态不佳,及高库存压力而采取自主停产检修。供需方面,钢厂减产,需求端铁水连续6周下降,库存同期高位波动。驱动方面,钢厂控产主动去旧标库存,铁矿跟随成材波动。技术上,日K在10日和20日均线下方,小时K在10日和20日均线下方,操作上,支撑位关注688.5,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。