

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)	689.50	-14.00↓	I主力合约持仓量(手)	550,183	+13369↑
	I1-5合约价差(元/吨)	11	-2.50↓	合约前20名净持仓(手)	-23312	-1275↓
	I大商所仓单(手)	2,500.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力截止15:00报价(美元/吨)	92.25	-2.15↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	753	-17↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	737	-16↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	629	-13↓	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	47	-2↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	93.30	-2.85↓	铁废价差	-47.00	-41.00↓
	进口成本预估值(元/吨)	780	-23↓			
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	+28.00↑
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	26.46	+0.03↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.985	-0.02↓
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,%)	35.54	+0.09↑	标的历史40日波动率(日,%)	30.19	-0.21↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	30.73	0.00	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	30.18	0.00
行业消息	1.截至9月2日,中国47港进口铁矿石库存总量15991.87万吨,较上一周增加185万吨;45港库存总量15331.87万吨,环比增加175万吨。					
	2.大商所增设鞍钢矿业、天津港远航国际公司为铁矿石指定交割仓库,在进一步扩大铁矿石可供交割资源、夯实交割基本盘的基础上,将推动更多钢矿企业利用期货工具进行定价和风险管理,为服务国内钢铁产业链高质量发展和重要矿产资源保供稳价提供期货方案。					
观点总结	9月4日铁矿2501收盘689.5,下跌3.09%。宏观面,宏观面,大宗商品市场情绪偏空,恐慌指数VIX近日大幅上涨,宏观波动率急剧上升。基本面,需求端铁水连续6周下降,库存同期高位。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						



更多资讯请关注!



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。