

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	主力合约收盘价(元/吨)	901.50	-2.00↓	主力合约持仓量(手)	673,854	-11302↓
	9-1合约价差(元/吨)	84	+5.00↑	合约前20名净持仓(手)	538	-4608↓
	大商所仓单(手)	1,800.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	133.5	-1.08↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,048	-4↓	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,029	-12↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	886	-5↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	128	-10↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	136.60	-4.95↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.80	+0.01↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,077	-33↓			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,641.80	+564.10↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,093.80	-182.20↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,845.33	-388.47↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,820.84	+101.66↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,251.70	+645.70↑	铁矿石可用天数(周, 天)	25.00	+1.00↑
	全国126座矿山产能利用率(旬, %)	64.81	+1.95↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	230.63	+16.88↑
下游情况	BDI指数	2,260.00	-60.00↓	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	12.38	-0.11↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	31.20	-0.17↓			
期权市场	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.11	+0.43↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	90.14	+0.24↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,278	+448↑			
行业消息	标的历史20日波动率(日, %)	37.48	+0.09↑	标的历史40日波动率(日, %)	49.70	+1.34↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	41.30	-1.37↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	41.33	-1.92↓
观点总结	1、高盛修正美联储加息预期, 即美联储将在6月和7月各加息75个基点; 预计美联储9月份将加息50个基点, 11月和12月将加息25个基点。预计到2022年底, 美国中性利率将达到3.25%-3.5%; 预计美联储在2023年还会有两次加息, 将利率升至3.75%-4%。 2、根据Mysteel卫星数据显示, 2022年6月6日-6月12日期间, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1282.7万吨, 周环比增加32.3万吨, 处于今年以来的偏高水平。					
	周二I2209合约先抑后扬, 进口铁矿石现货报价继续下调。美国5月通胀数据强化了市场对美联储继续激进加息的预期, 美元指数继续走高利空大宗商品价格, 另外本期奥巴铁矿石发运总量大幅回升, 但到港量减少, 市场仍预期本周港口库存或继续下滑对矿价构成一定支撑。短线行情或有反复, 应注意操作节奏。技术上, I2209合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上建议, 短线仍考虑震荡偏空交易, 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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!