



撰写人：许方莉 从业资格证号：F3073708 投资咨询从业证书号：Z0017638

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)	785.50	-26.50↓	I 主力合约持仓量(手)	865,473	-61445↓
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	73	-5.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	194	-25422↓
	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)	108.85	-3.74↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	894	-11↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	876	-13↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	763	-7↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	90	+14↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	116.65	+2.15↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.37	+0.07↑
	进口成本预估值(元/吨)	969	+19↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,601.00	-44.10↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,474.20	+462.60↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,622.26	-130.28↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,470.85	-72.32↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,617.50	+573.50↑	铁矿石可用天数(周, 天)	15.00	-1.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	63.00	+0.89↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	142.34	-2.72↓
	BDI指数	1,055.00	+15.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.70	+0.18↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	8.735	+0.07↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	82.36	0.00	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	89.67	+0.01↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,264	-309↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	36.56	+0.71↑	标的历史40日波动率(日, %)	34.65	+0.88↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	34.84	+0.55↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	35.70	-0.30↓
行业消息	1、6月5日-6月11日中国47港到港总量2474.2万吨，环比增加462.6万吨；中国45港到港总量2313.4万吨，环比增加353.2万吨；北方六港到港总量为1179.9万吨，环比增加296.3万吨。 2、6月5日-6月11日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量 2601.0万吨，环比减少44.1万吨。澳洲发运量1849.9万吨，环比减少66.0万吨，其中澳洲发往中国的量1488.2万吨，环比减少151.2万吨。巴西发运量751.1万吨，环比增加21.9万吨。					 <div>更多资讯请关注！</div>
观点总结	周一I2309合约减仓下行，进口铁矿石现货报价下调。本期铁矿石到港量明显增加，另外国内将加快优质铁矿项目建设，将提升现货供应。贸易商报盘积极，贸易商投机需求较弱；需求端，区域内钢厂亏损有所收缩背景下仍以压低库存为主。技术上，I2309合约1小时MACD 指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议，反弹抛空，注意操作节奏及风险控制。					 <div>更多观点请咨询！</div>
重点关注						