



撰写人：蔡跃辉
 从业资格证号：F0251444
 投资咨询从业证书号：Z0013101

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)	829.50	+1.50↑	I 主力合约持仓量(手)	842,683	-2847↓
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	71.5	+1.50↑	I 合约前20名净持仓(手)	16691	-4182↓
	I 大商所仓单 (手)	1,700.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	109.85	+0.22↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	931	+12↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	915	+10↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	794	+6↑	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	85	+8↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	111.55	+1.05↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.39	-0.04↓
	进口成本预估值(元/吨)	939	+10↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,943.90	+266.10↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,428.00	+60.00↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,742.00	-50.98↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,544.52	-29.85↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,617.00	+573.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	-1.00↓
	全国126座矿山开工率(旬, %)	65.65	+1.23↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	119.38	-0.80↓
	BDI指数	994.00	-50.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.06	-0.45↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.96	-0.19↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.09	0.00	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.98	+0.38↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,012	-251↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	24.00	-0.07↓	标的历史40日波动率(日, %)	31.12	-0.20↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	26.41	-1.98↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	27.40	-1.13↓
行业消息	1、6日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2430.07万吨，环比上期降2.97万吨。烧结粉总日耗111.52万吨，增0.92万吨。库存消费比21.79，降0.21。 2、6月26日-7月2日，澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1240.5万吨，周环比下降95.1万吨，库存连续两期下降，目前处于年内均值附近。					 更多资讯请关注！
观点总结	周四I2309合约震荡偏强，进口铁矿石现货报价上调。本期铁矿石到港量及发运量均出现增加，将提升现货供应。贸易商报盘积极性一般，报价随行就市，钢厂刚需补库为主，多持观望状态。目前钢厂生产积极性尚可，铁水维持高位波动，短期铁矿需求仍存韧性。技术上，I2309合约1小时MACD 指标显示DIFF与 DEA运行于0轴附近。操作上建议，回调择机短多，注意风险控制。					 更多观点请咨询！
重点关注	周五国内铁矿石港口库存、钢厂高炉开率及产能利用率					

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