

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)	829.00	+4.00↑	I 主力合约持仓量(手)	815,744	+19257↑
	I 9-1合约价差(元/吨)	83	+2.00↑	I 合约前20名净持仓(手)	34392	+8723↑
	I 大商所仓单(手)	1,500.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	109.9	+0.97↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	926	+14↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	909	+15↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	788	+7↑	I 主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	80	+11↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	110.55	+2.95↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.41	-0.03↓
	进口成本预估值(元/吨)	924	+21↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,432.40	-511.50↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,514.50	+86.50↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,638.56	-103.44↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,630.37	+85.85↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,551.80	-65.20↓	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	0.00
	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	1,088.00	+56.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	8.105	+0.01↑
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.89	+0.15↑			
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.48	+0.39↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	92.11	+0.13↑
	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, %)	20.79	-0.99↓	标的历史40日波动率(日, %)	29.70	-0.03↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	26.01	+1.42↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	25.13	+0.04↑
行业消息	1、美国通胀大幅降温, 6月CPI涨幅超预期回落。美国劳工统计局公布数据显示, 美国6月CPI同比上涨3%, 这是美国CPI同比涨幅自2022年6月创出40年来峰值9.1%后连续12个月下降, 为2021年3月以来最小增幅, 预估为3.1%, 前值为4.0%。 2、13日Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2381.26万吨, 环比上期降48.81万吨。烧结粉总日耗111.75万吨, 增0.23万吨。库存消费比21.31, 降0.48。					
观点总结	周四I2309合约增仓走高, 进口铁矿石现货报价上调。贸易商报价积极性尚可, 报价多随行就市, 近期钢厂利润有所收窄, 叠加下游成材需求依旧疲软, 故钢厂采购较为谨慎, 维持低库存运行。只是美国通胀数据下滑降低加息预期, 提振期价继续反弹。技术上, I2309合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向上反弹。操作上建议, 震荡偏多交易, 注意风险控制。					
重点关注	周五国内铁矿石港口库存、钢厂高炉开工率及产能利用率					

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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!