

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	主力合约收盘价(元/吨)	770.00	+3.50↑	主力合约持仓量(手)	884,180	+30378↑
	9-1合约价差(元/吨)	66	+6.00↑	合约前20名净持仓(手)	16899	+9723↑
	大商所仓单(手)	2,300.00	+100.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	107.6	+1.23↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	877	+4↑	青岛港61%麦克粉矿(元/干吨)	860	+1↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	747	+6↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	90	-2↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	109.90	+0.90↑	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)	914	+9↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,645.10	+167.60↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,011.60	-397.30↓
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,752.54	-41.29↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,543.17	-92.16↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,617.50	+573.50↑	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	0.00
	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	1,016.00	+77.00↑	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	8.74	+0.75↑
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.18	+0.90↑			
	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, %)	89.66	-0.27↓
	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, %)	37.39	-0.19↓	标的历史40日波动率(日, %)	33.65	+0.01↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	33.75	+0.77↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	33.73	-0.22↓
行业消息	1、5月中国进口铁矿砂及其精矿9617.5万吨, 较上月增加573.3万吨, 环比增长6.3%; 1-5月累计进口铁矿砂及其精矿48074.8万吨, 同比增长7.7%。 2、5月29日-6月4日, 中国47港到港总量2011.6万吨, 环比减少397.3万吨; 中国45港到港总量1960.2万吨, 环比减少283.9万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周三I2309合约高位整理, 进口铁矿石现货报价小幅上调。本期铁矿石到港量减少, 将降低现货供应, 另外钢厂高炉开工率及产能利用率预期上调, 将增加铁矿石现货需求。贸易商报盘积极性一般, 投机需求较少, 报价多随行就市; 钢厂方面部分有招标采购计划, 以按需补库为主。随着钢价陷入调整, 或再度挤压矿价。技术上, I2309合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA高位整理。操作上建议, 择机短空, 注意操作节奏及风险控制。					
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