

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)	698.00	+2.50↑	主力合约持仓量(手)	678,221	-6843↓
	9-1合约价差(元/吨)	26	+1.00↑	合约前20名净持仓(手)	-49494	+1083↑
	大商所仓单(手)	3,100.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	92.75	+0.35↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	768	-2↓	青岛港60.8%麦克粉矿(元/干吨)	750	-1↓
	京唐港56.5%超特粉矿(元/干吨)	660	-5↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	52	-4↓
	铁矿石62%普氏指数(前一日, 美元/吨)	92.75	-0.35↓	江苏废钢/青岛港60.8%麦克粉矿	3.66	+0.01↑
	进口成本预估值(元/吨)	767	-3↓			
产业情况	澳洲铁矿石发运离港量(周, 万吨)	3,352.70	-157.70↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,517.50	-156.40↓
	45港铁矿石库存量(周, 万吨)	13,933.14	+106.45↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,798.68	+108.50↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,813.00	-501.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	22.00	+5↑
	266座矿山日产量(周, 万吨)	38.98	+0.50↑	266座矿山开工率(周, %)	61.42	+0.23↑
下游情况	266座矿山铁精粉库存(周, 万吨)	58.33	-4.46↓	BDI指数	1,874.00	-78.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	25.07	-0.80↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.62	-0.91↓
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	83.39	-0.15↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	90.56	-0.07↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	8,655	+53↑			
期权市场	标的历历史20日波动率(日, %)	13.23	-0.08↓	标的历历史40日波动率(日, %)	18.83	-0.19↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	16.94	-1.02↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	17.32	-0.35↓
行业消息	<p>1、6月9日-6月15日, 澳大利亚、巴西七个主要港口铁矿石库存总量1226.2万吨, 环比下降25.9万吨, 库存连续三期下滑, 绝对量处于二季度以来的中等偏下水平。</p> <p>2、Mysteel统计新口径114家钢厂进口烧结粉总库存2719.47万吨, 环比上期增56.73万吨。进口烧结粉总日耗117.81万吨, 环比上期增1.56万吨。库存消费比23.08, 环比上期增0.17。原口径64家钢厂进口烧结粉总库存1216.14万吨, 环比上期增11.12万吨。</p>					
观点总结	<p>周四I2509合约减仓整理。宏观方面, 美联储宣布将联邦基金利率目标区间维持在4.25%至4.50%之间不变, 这是该行连续第四次决定维持利率不变, 美联储官员预计2025年将降息两次。供需情况, 本期澳洲铁矿石发运和到港量下滑, 国内港口库存增加; 钢厂高炉开工率和铁水产量延续下滑, 铁矿需求支撑减弱。技术上, I2509合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA运行于0轴下方。操作上, 关注705附近压力, 短线交易, 注意节奏和风险控制。</p>					
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

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101

#### 免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料, 瑞达期货股份有限公司力求准确可靠, 但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证, 据此投资, 责任自负。本报告不构成个人投资建议, 客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有, 未经书面许可, 任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发, 需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院, 且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。



更多资讯请关注!

