

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)	834.00	-11.00↓	I 主力合约持仓量(手)	764,198	-55401↓
	I 9-1 合约价差 (元/吨)	76.5	-4.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	43012	-3421↓
	I 大商所仓单 (手)	4,500.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15：00报价(美元/吨)	112.45	-1.24↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	936	+51	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	921	+21
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	796	+21	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	87	+131
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	115.85	+0.80↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.39	-0.01↓
	进口成本预估值(元/吨)	966	+71			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,449.30	+16.90↑	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,534.60	+20.00↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,495.17	-143.39↓	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	8,522.33	-108.04↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,552.00	-65.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	16.00	0.00
	全国126座矿山开工率(旬, %)	67.84	+2.19↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	110.40	-8.98↓
	BDI指数	1,037.00	-36.00↓			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	19.53	-0.16↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.63	-0.12↓
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	84.33	-0.15↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	91.20	-0.91↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,111	+99↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	24.06	+0.40↑	标的历史40日波动率(日, %)	28.83	-0.76↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	24.81	-0.46↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	24.42	-0.51↓
行业消息	1、7月10日-7月16日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2449.3万吨，环比增加16.9万吨。澳洲发运量1736.6万吨，环比增加1.5万吨，其中澳洲发往中国的量1539.4万吨，环比增加135.2万吨。巴西发运量712.7万吨，环比增加15.4万吨。 2、国家发改委：将抓紧制定出台恢复和扩大消费的政策，围绕稳定大宗消费、促进汽车消费和电子产品消费、拓展农村消费、优化消费环境等方面，出台一批务实管用的政策举措并推动尽快落地见效。					 更多资讯请关注！
观点总结	周三I2309合约减仓整理，进口铁矿石现货报价上调。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均小幅增加，将提升现货供应。贸易商报价积极性尚可，报价随行就市为主；钢厂方面，部分钢厂刚需补库，由于钢厂维持小幅盈利，主动减产意愿不强，铁水产量维持高位震荡。另外，国家发改委表示，将抓紧制定出台恢复和扩大消费的政策，对矿价也存在一定支撑。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，回调择机做多，注意风险控制。					 更多观点请咨询！
重点关注						