

撰写人: 陈一兰 从业资格证号: F3010136 投资咨询从业证书号: Z0012698

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)	741.00	-14.50↓	I 主力合约持仓量(手)	659,617	+12636↑
	I 9-1合约价差 (元/吨)	70.5	-2.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	-27272	-4377↓
	I 大商所仓单 (手)	2,200.00	+700.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	110.75	-2.16↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	864	-27↓	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	830	-34↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	734	-15↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	89	-19↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	114.05	-0.80↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.93	+0.01↑
	进口成本预估值(元/吨)	898	-8↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,374.30	-286.80↓	中国45港到港总量(周, 万吨)	2,893.40	+570.40↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	12,654.62	+83.05↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,489.38	-51.64↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	9,252.00	+646.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	24.00	+2.00↑
	全国126座矿山产能利用率(旬, %)	64.57	+0.35↑	全国126座矿山库存量(旬, 万吨)	209.34	+4.24↑
	BDI指数	2,067.00	-6.00↓			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	30.13	+0.20↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	11.385	-0.05↓
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	78.53	-2.26↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	85.71	-1.90↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	9,661	+384↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	61.83	-0.09↓	标的历史40日波动率(日, %)	52.43	+0.58↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	56.61	-2.51↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	58.37	-2.38↓
行业消息	1、7月4日-7月10日中国47港到港总量2893.4万吨, 环比增加570.4万吨; 中国45港到港总量2829.1万吨, 环比增加603.5万吨; 北方六港到港总量为1448.6万吨, 环比增加318.0万吨。 2、7月4日-7月10日Mysteel澳洲巴西19港铁矿发运总量2374.3万吨, 环比减少286.8万吨。澳洲发运量1723.3万吨, 环比减少146.2万吨, 其中澳洲发往中国的量1389.8万吨, 环比减少176.7万吨。巴西发运量651.0万吨, 环比减少140.6万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2209合约承压下挫, 进口铁矿石现货报价大幅下调。美国非农数据好于预期, 强化美联储7月继续加息75个基点的决心。此外, 对全球经济衰退担忧的加剧, 叠加钢厂高炉检修增多, 铁矿石现货需求减少预期增强, 钢厂生产压力仍存, 多维持按需少量补库, 采购积极性不佳。技术上, I2209合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下调整。操作上建议, 反弹择机抛空, 止损参考770。					 更多观点请咨询!
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