

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)	695.50	-36.50↓	I 主力合约持仓量(手)	652,414	-26350↓
	I 9-1合约价差 (元/吨)	65	-4.00↓	I 合约前20名净持仓(手)	-33229	-11686↓
	I 大商所仓单 (手)	2,600.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	100.65	-8.12↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	835	+3↑	青岛港61%麦克粉矿 (元/干吨)	813	+5↑
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	712	-5↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	118	+42↑
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	109.40	+3.60↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.73	-0.09↓
	进口成本预估值(元/吨)	867	+27↑			
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)	8,896.90	-355.10↓	铁矿石可用天数(周, 天)	24.00	0.00
	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	2,002.00	-11.00↓			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	30.73	+0.33↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.59	+0.32↑
	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, %)	66.06	+1.62↑	标的历史40日波动率(日, %)	53.94	+0.23↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	60.52	-0.70↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	63.11	+1.35↑
行业消息	<p>1、隔夜美国CPI数据强于市场预期，而且再创逾40年最大涨幅，多位美联储官员释放了7月份加息100个基点的预期，利率期货也反映美联储7月份加息100个基点的概率大增至80%。</p> <p>2、据Mysteel了解到，由于海外钢材需求持续低迷加上天然气短缺，欧洲钢厂大部分处于不饱和生产状态，部分钢厂将检修计划提前，产能利用率大多维持在70-80%。</p>					 <p>更多资讯请关注!</p>
观点总结	<p>周四I2209合约减仓下行。美国6月CPI数据强于市场预期，而且再创逾40年最大涨幅，多位美联储官员释放了7月份加息100个基点的预期，美元走强继续打压大宗商品价格，另外国内钢厂高炉检修增多，铁矿石现货需求减少预期增强，叠加港口库存逐步回升，后市期价或震荡偏弱。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，注意风险控制。</p>					 <p>更多观点请咨询!</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