



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)	960.50	-19.00↓	主力合约持仓量(手)	530,700	-10282↓
	5-9合约价差(元/吨)	72.5	0.00	合约前20名净持仓(手)	75333	-3248↓
	大商所仓单(手)	2,900.00	+100.00↑			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	129.8	-3.04↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,073	-38↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,059	-43↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	963	-16↓	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	98	-24↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	134.80	-2.65↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.07	+0.04↑
	进口成本预估值(元/吨)	1,112	-22↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨)	2,292.90	+139.90↑	中国47港到港总量(周,万吨)	2,450.80	-319.40↓
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	12,766.21	+127.82↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	10,523.59	+279.71↑
	铁矿石进口量(月,万吨)	10,086.00	-188.00↓	铁矿石可用天数(周,天)	28.00	+4↑
	全国186座矿山开工率(旬,%)	63.88	-0.28↓	全国186座矿山日产量(旬,万吨)	49.88	-0.22↓
	BDI指数	1,397.00	-63.00↓			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	20.88	-0.19↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.55	-0.20↓
	247家钢厂高炉开工率(周,%)	76.84	+0.59↑	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	83.52	+0.52↑
	国内粗钢产量(月,万吨)	6,744	-866↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	25.01	+0.02↑	标的历史40日波动率(日,%)	25.30	+0.41↑
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	27.33	+1.65↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	26.04	-0.14↓
行业消息	1、1月31日,IMF高级官员表示,亚洲的通胀压力“正在迅速消退”,强化该地区经济软着陆的前景。许多亚洲央行有望在2024年实现通胀目标,今年晚些时候或将出现货币宽松的空间。2024年亚洲经济增长预期从10月时的4.2%上调至4.5%。 2、淡水河谷2023年第四财季铁矿石产量为8940万吨,分析师预期为8297万吨;第四财季铁矿石销量为7789万吨,分析师预期为8107万吨;第四财季镍产量为4.49万吨,上一季度为4.21万吨。				 更多资讯请关注!	
观点总结	周三I2405合约减仓下行,进口铁矿石现货报价继续下调。本期澳巴铁矿石发运量增加,而到港量减少,同时卸货入库量预计继续下滑。但股市下行及铁矿石产量预期增加影响市场信心,贸易商报价积极性不高,钢厂对原料补库基本结束,只维持少量刚需补库节奏。另外期货主流持仓多单继续减少,对期价构成压力。技术上,I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA向下运行。操作上建议,反弹择机短空,注意风险控制。					
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!

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
助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823 王凯慧 期货从业资格号F03100511
王世霖 期货从业资格号F03118150

备注: I: 铁矿石

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。