



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)	944.00	+5.00↑	I主力合约持仓量(手)	467,367	-17671↓
	I5-9合约价差(元/吨)	67	+1.00↑	I合约前20名净持仓(手)	65712	-1530↓
	I大商所仓单(手)	2,500.00	-100.00↓			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	124.9	-0.10↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	1,043	-5↓	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	1,024	-13↓
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	926	0.00	I主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	80	-18↓
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	125.50	-1.70↓	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.13	0.00
	进口成本预估值(元/吨)	1,038	-14↓			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周,万吨)	2,325.30	+32.40↑	中国47港到港总量(周,万吨)	2,481.60	+30.80↑
	45港铁矿石港口库存量(周,万吨)	12,949.06	+182.85↑	样本钢厂铁矿石库存量(周,万吨)	10,823.97	+300.38↑
	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	0.00
	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	1,516.00	+80.00↑			
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	23.08	+0.82↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	9.05	+0.53↑
	247家钢厂高炉开工率(周,%)	76.50	-0.34↓	247家钢厂高炉产能利用率(周,%)	83.59	+0.07↑
	国内粗钢产量(月,万吨)	6,744	-866↓			
期权市场	I标的历史20日波动率(日,%)	24.15	-2.33↓	I标的历史40日波动率(日,%)	24.53	-0.27↓
	I平值看涨期权隐含波动率(日,%)	28.28	0.00	I平值看跌期权隐含波动率(日,%)	27.86	-0.88↓
行业消息	1、1月29日-2月4日中国47港到港总量2481.6万吨,环比增加30.8万吨;中国45港到港总量2472.3万吨,环比增加162.9万吨;北方六港到港总量为1416.4万吨,环比增加322.5万吨。 2、据中国物流与采购联合会发布,2024年1月份全球制造业PMI为49.3%,较上月上升1.3个百分点,摆脱了连续9个月49%以下运行走势,创出自2023年3月以来新高。					 更多资讯请关注!
观点总结	周三I2405合约减仓整理,进口铁矿石现货报价稳中有跌。本期澳巴铁矿石发运量和到港量均小幅增加,提升铁矿石现货供应。目前港口各品种贸易资源较为充足,港口船只集中到港,压港天数较高。需求端,多数钢厂节前补库已经结束,铁矿石市场需求整体减弱。股市反弹提振市场信心,叠加期货贴水现货,下行空间受限。技术上,I2405合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位反弹。操作上建议,日内震荡偏多交易,轻仓过节,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。