

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)	890.00	+18.50↑	I 主力合约持仓量(手)	514,024	+3338↑
	I 5-9合约价差 (元/吨)	64.5	-1.50↓	I 合约前20名净持仓(手)	48452	-1004↓
	I 大商所仓单 (手)	2,300.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	115.4	+2.15↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	947	-32↓	天津港61%麦克粉矿 (元/干吨)	936	-32↓
	青岛港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	840	-37↓	I 主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	46	-50↓
	铁矿石62%普氏指数 (美元/吨)	117.10	+0.20↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.42	+0.08↑
	进口成本预估值(元/吨)	970	+1↑			
产业情况	澳巴铁矿石发运离港量(周, 万吨)	2,544.50	+466.00↑	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,524.40	+405.60↑
	45港铁矿石港口库存量(周, 万吨)	13,888.57	+281.31↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,333.19	-197.77↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	10,086.00	-188.00↓	铁矿石可用天数(周, 天)	22.00	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	2,203.00	+92.00↑			
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	28.39	+0.56↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	13.35	+0.88↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	75.17	-0.44↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	83.32	-0.25↓
	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, %)	29.54	+1.48↑	标的历史40日波动率(日, %)	27.81	+0.29↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	27.39	-2.72↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	28.62	+0.28↑
行业消息	1、2024年2月26日-3月3日Mysteel澳洲巴西铁矿发运总量2544.5万吨, 环比增加466.0万吨。澳洲发运量1836.1万吨, 环比增加426.0万吨, 其中澳洲发往中国的量1450.8万吨, 环比增加417.8万吨。巴西发运量708.4万吨, 环比增加40.0万吨。 2、2月26日-3月3日中国47港到港总量2524.4万吨, 环比增加405.6万吨; 中国45港到港总量2377万吨, 环比增加346.4万吨; 北方六港到港总量为1241.6万吨, 环比增加173.7万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2405合约先抑后扬。本期澳巴铁矿石发运量及到港量均明显增加, 将提升现货供应。由于当前港口各品种贸易资源较为充足, 而钢厂利润收缩继续向上挤压炉料。贸易商出货积极性不高, 报价多随行就市, 钢厂采购以按需补库为主, 采购较为谨慎。整体上, 多空因素交织, 短线行情仍有反复, 注意操作节奏。技术上, I2405合约1小时 MACD指标显示DIFF与 DEA运行于0轴下方。操作上建议, 日内短线交易, 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。