

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)	879.50	-10.50↓	主力合约持仓量(手)	517,733	+3709↑
	5-9合约价差(元/吨)	60.5	-4.00↓	合约前20名净持仓(手)	47763	-689↓
	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)	114.5	-1.12↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	961	+3↑	天津港61%麦克粉矿(元/干吨)	950	+3↑
	青岛港56.5%超特粉矿(元/干吨)	856	+16↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	71	+14↑
	铁矿石62%普氏指数(美元/吨)	117.75	+2.35↑	江苏废钢/青岛港61%麦克粉矿(比值)	3.36	-0.06↓
	进口成本预估值(元/吨)	975	+19↑			
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	2,297.00	+94.00↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	14.22	+0.87↑
下游情况	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	28.97	+0.58↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	14.22	+0.87↑
	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	标的历历史20日波动率(日, %)	29.13	-0.41↓	标的历历史40日波动率(日, %)	27.63	-0.18↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	31.31	+3.92↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	29.95	+1.33↑
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。					
观点总结	周二I2405合约震荡偏弱。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。贸易商报价积极性一般, 多随行就市, 贸易商投机情绪不佳, 钢厂询盘谨慎, 维持按需采购。整体上, 铁矿石多空因素交织, 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, 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  
助理研究员: 李秋荣 期货从业资格号F03101823  
王世霖 期货从业资格号F03118150

备注: I: 铁矿石

期货投资咨询从业证书号Z0013101  
王凯慧 期货从业资格号F03100511

## 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。