

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)	784.50	+12.50↑	主力合约持仓量(手)	473,257	-1499↓
	I 5-9合约价差 (元/吨)	26.5	+1.00↑	合约前20名净持仓(手)	-38499	-3558↓
	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)	103.1	+1.51↑			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿 (元/干吨)	832	+13↑	青岛港60.5%麦克粉矿 (元/干吨)	823	+12↑
	京唐港56.5%超特粉矿 (元/干吨)	729	+14↑	主力合约基差 (麦克粉干吨-主力合约)	39	-1↓
	铁矿石62%普氏指数 (前一日, 美元/吨)	102.65	+1.30↑	江苏废钢/青岛港60.5%麦克粉矿	3.18	-0.07↓
	进口成本预估值(元/吨)	817	+12↑			
产业情况	全球铁矿石发运总量(周, 万吨)	2,897.80	-442.90↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,697.50	+467.50↑
	47港铁矿石库存量(周, 万吨)	17,894.83	+3.53↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	9,011.57	-73.53↓
	铁矿石进口量(月, 万吨)	11,965.00	+911.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	21.00	0.00
	266座矿山日产量(周, 万吨)	38.60	+1.48↑	266座矿山开工率(周, %)	60.90	+1.87↑
	266座矿山铁精粉库存(周, 万吨)	50.17	+8.45↑	BDI指数	2,010.00	-128.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	25.80	+0.03↑	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	10.75	+0.23↑
下游情况	247家钢厂高炉开工率(周, %)	77.69	-2.55↓	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	85.30	-2.18↓
	国内粗钢产量(月, 万吨)	6,818	-169↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	16.15	+0.94↑	标的历史40日波动率(日, %)	18.00	+0.47↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	21.51	+3.31↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	23.88	+4.82↑
行业消息	1、2026年3月2日-3月8日Mysteel全球铁矿石发运总量2897.8万吨, 环比减少442.9万吨。澳洲巴西铁矿发运总量2342.1万吨, 环比减少348.5万吨。澳洲发运量1753.2万吨, 环比减少195.3万吨, 其中澳洲发往中国的量1465.9万吨, 环比减少105.1万吨。巴西发运量589.0万吨, 环比减少153.3万吨。 2、2026年03月02日-03月08日中国47港到港总量2697.5万吨, 环比增加467.5万吨; 中国45港到港总量2609.9万吨, 环比增加463.0万吨; 北方六港到港总量1464.5万吨, 环比增加431.7万吨。					 更多资讯请关注!
观点总结	周一I2605合约减仓上行。宏观面, 美国总统特朗普表示, 与伊朗不会达成任何协议, 除非其无条件投降。供需情况, 本期澳巴铁矿石发运量减少, 到港量增加, 华北钢厂限产, 铁水产量下滑, 铁矿港口库存继续增加, 但短期受美伊冲突影响油价大涨推高运费, 铁矿石期现货价格重心上移。技术上, I2605合约1小时 MACD 指标显示DIFF与DEA向上走高, 红柱平稳。观点参考, 震荡偏多, 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!

备注: I: 铁矿石

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

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。