

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)	762.50	+1.00↑	主力合约持仓量(手)	506,957	-6983↓
	5-9合约价差(元/吨)	17.5	0.00	合约前20名净持仓(手)	-22383	-5244↓
	大商所仓单(手)	2,900.00	0.00			
	新加坡铁矿石主力合约截止15:00报价(美元/吨)	99.9	-0.28↓			
现货市场	青岛港61.5%PB粉矿(元/干吨)	823	+2↑	青岛港60.5%麦克粉矿(元/干吨)	812	+3↑
	京唐港56.5%超特粉矿(元/干吨)	723	+2↑	主力合约基差(麦克粉干吨-主力合约)	49	+2↑
	铁矿石62%普氏指数(前一日, 美元/吨)	100.20	0.00	江苏废钢/青岛港60.5%麦克粉矿	3.23	-0.03↓
	进口成本预估值(元/吨)	801	-0↓			
产业情况	全球铁矿石发运总量(周, 万吨)	2,535.30	-559.30↓	中国47港到港总量(周, 万吨)	2,455.60	-213.60↓
	47港铁矿石库存量(周, 万吨)	17,914.68	+156.42↑	样本钢厂铁矿石库存量(周, 万吨)	10,316.64	+348.05↑
	铁矿石进口量(月, 万吨)	11,965.00	+911.00↑	铁矿石可用天数(周, 天)	32.00	+3↑
	266座矿山日产量(周, 万吨)	38.51	-1.05↓	266座矿山开工率(周, %)	61.27	-1.67↓
下游情况	266座矿山铁精粉库存(周, 万吨)	39.07	-2.71↓	BDI指数	1,882.00	-13.00↓
	铁矿石运价:巴西图巴朗-青岛(美元/吨)	22.35	-0.64↓	铁矿石运价:西澳-青岛(美元/吨)	7.944	-0.12↓
	247家钢厂高炉开工率(周, %)	79.55	+0.53↑	247家钢厂高炉产能利用率(周, %)	85.71	+0.26↑
	国内粗钢产量(月, 万吨)	6,818	-169↓			
期权市场	标的历20日波动率(日, %)	15.22	-0.03↓	标的历40日波动率(日, %)	16.80	-0.18↓
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	19.68	+0.18↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	18.12	-0.47↓
行业消息	<p>1、2026年2月2日-2月8日Mysteel全球铁矿石发运总量2535.3万吨, 环比减少559.3万吨。澳洲巴西铁矿发运总量1948.9万吨, 环比减少572.1万吨。澳洲发运量1279.8万吨, 环比减少540.6万吨, 其中澳洲发往中国的量1097.5万吨, 环比减少521.6万吨。巴西发运量669.0万吨, 环比减少31.5万吨。</p> <p>2、2026年02月02日-02月08日中国47港到港总量2455.6万吨, 环比减少213.6万吨; 中国45港到港总量2361.3万吨, 环比减少123.4万吨; 北方六港到港总量1264.0万吨, 环比减少24.7万吨。</p>					
观点总结	<p>周三I2605合约减仓整理。宏观方面, 美国总统特朗普称他正在考虑, 若与伊朗的谈判未能取得成果, 或向中东地区再派遣一支美国航母打击群, 为可能的军事行动做准备。供需情况, 本期澳巴铁矿石发运量和到港量下滑, 钢厂高炉开工率平稳, 铁水产量维持230万吨下方, 铁矿石港口库存再创新高。整体上, 随着春节假期临近钢厂补库需求较少, 另外近日澳洲受到飓风影响, 发运量降幅明显, 同时央行报告重申适度宽松, 行情或有反复。技术上, I2605合约1小时MACD指标显示DIFF与DEA低位反弹。观点参考, 短线交易, 注意风险控制。</p>					
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。



更多资讯请关注!

