

撰写人：陈一兰 从业资格证号：F3010136 投资咨询从业证书号：Z0012698

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	SM主力合约收盘价(日, 元/吨)	7,190.00	-204.00↓	SF主力合约收盘价(日, 元/吨)	7,768.00	-260.00↓
	SM主力合约持仓量(日, 手)	125,324.00	+171.00↑	SF主力合约持仓量(日, 手)	121,256.00	+8699.00↑
	锰硅前20名净持仓(日, 手)	12,272.00	+7442.00↑	硅铁前20名净持仓(日, 手)	-7,908.00	-158.00↓
	SM1-9月合约价差(日, 元/吨)	-62.00	+16.00↑	SF1-9月合约价差(日, 元/吨)	-74.00	+44.00↑
	SM仓单(日, 张)	23,671.00	+121.00↑	SF仓单(日, 张)	8,110.00	+343.00↑
现货市场	内蒙古锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,200.00	-50.00↓	内蒙古硅铁FeSi75-B (日, 元/吨)	7,950.00	0.00
	贵州锰硅FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7300.00	0.00	青海硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,550.00	-100.00↓
	云南锰硅FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,050.00	0.00	宁夏硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,800.00	0.00
	锰硅指数均值(周, 元/吨)	7216.00	-172.00↓	SF主力合约基差(日, 元/吨)	32.00	+260.00↑
	SM主力合约基差(日, 元/吨)	10.00	+204.00↑			
上游情况	南非矿:Mn38块·天津港(日, 元/吨度)	36.00	0.00	硅石(98% 西北, 日, 元/吨)	220.00	0.00
	内蒙古乌海二级冶金焦(日, 元/吨)	2020.00	0.00	兰炭(中料神木, 日, 元/吨)	1500.00	0.00
	锰矿港口库存(周, 万吨)	534.10	+31.30↑			
产业情况	锰硅企业开工率(周, %)	30.12	-2.95↓	硅铁企业开工率(周, %)	38.97	-0.67↓
	锰硅供应(周, 吨)	132,895.00	-9590.00↓	硅铁供应(周, 万吨)	9.10	-0.20↓
	锰硅厂家库存(半月, 万吨)	25.14	+3.17↑	硅铁厂家库存(半月, 万吨)	6.60	+0.68↑
	锰硅全国钢厂库存(月, 天数)	19.11	-2.89↓	硅铁全国钢厂库存(月, 天数)	19.51	-1.82↓
下游情况	五大钢种锰硅需求(周, 吨)	126690.00	+256.00↑	五大钢种硅铁需求(周, 吨)	21516.50	+68.30↑
	全国247家钢厂高炉开工率(周, %)	71.61	-1.55↓	247家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %)	79.30	-2.10↓
	粗钢产量(月, 万吨)	9072.97	-588.33↓			
行业消息	1.据河北统计局网站发布的《2022年上半年全省规模以上工业企业利润总额下降43.0%》显示，上半年，在全省统计的39个工业大类行业中，10个行业利润总额比上年同期增加，行业增长面为25.6%。受钢铁生产成本持续高位影响，黑色金属冶炼和压延加工业利润总额同比下降94.5%，下拉全省利润32.1个百分点。 2.受市场需求不足、生产成本上升、销售价格下降等因素影响，上半年钢铁企业效益出现大幅下降。中钢协发布的最新数据显示，上半年会员钢铁企业实现利润总额1034亿元，同比下降55.47%；平均销售利润率为3.10%，同比下降3.53个百分点。从月度数据看，第二季度会员钢铁企业实现利润连续3个月环比下降。					
						更多资讯请关注！
观点总结	锰硅：锰硅现货价格弱稳运行。港口锰矿止跌小幅反弹，低位询盘积极性提高；焦炭小幅回升，成本端压力未减。9月锰矿外盘下调，近期锰硅成本维持高位。锰硅厂家库存压力仍存，停产持续。昨日河钢招标锰硅需求19700吨。市场等待主流钢厂定价指引，观望情绪较浓。太原开展污染防治，钢铁有压减产量政策，原料端需求承压。技术上，SM2209合约低开低走，一小时MACD指标显示绿色动能柱持续扩大，空方力量较强。操作建议：可尝试在7195附近轻仓短空，止损参考7277元/吨。					更多观点请咨询！
	硅铁：硅铁现货价格偏弱运行。兰炭企业累库，停产检修，价格暂稳。焦炭近期行情修复，小幅反弹，个别焦企有提涨意愿。硅铁现货暂稳，昨日河钢集团8月招标硅铁需求量2100吨。市场等待主流钢厂定价，目前以观望为主。太原开展污染防治，钢铁有压减产量政策，原料端需求承压。金属镁市市场弱稳运行，镁价跌速放缓。技术上，SF2209合约低开低走，一小时MACD指标显示绿色动能柱持续扩散，BOLL指标开口收窄，预计短期维持震荡偏弱行情。操作建议：可尝试在7600-7910区间低吸高抛，止损各60点。					
重点关注	8月5日Mysteel双硅开工率及厂家库存					

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：SM:锰硅 SF: 硅铁