

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)	7,406.00	+74.00↑	SF主力合约收盘价 (日, 元/吨)	8,304.00	+128.00↑
	SM主力合约持仓量 (日, 手)	171,839.00	+1241.00↑	SF主力合约持仓量 (日, 手)	122,509.00	-13811.00↓
	锰硅前20名净持仓 (日, 手)	-1,434.00	+302.00↑	硅铁前20名净持仓 (日, 手)	-9,124.00	-803.00↓
	SM5-1月合约价差 (日, 元/吨)	-98.00	-2.00↓	SF5-1月合约价差 (日, 元/吨)	-118.00	+18.00↑
	SM 仓单 (日, 张)	16,999.00	-576.00↓	SF 仓单 (日, 张)	7,494.00	-597.00↓
现货市场	内蒙古锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,200.00	0.00	内蒙古硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	8,000.00	0.00
	贵州锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7200.00	0.00	青海硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,800.00	0.00
	云南锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,100.00	0.00	宁夏硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	8,050.00	0.00
	锰硅指数均值 (周, 元/吨)	7126.00	+3.00↑	SF 主力合约基差 (日, 元/吨)	-254.00	-128.00↓
	SM 主力合约基差 (日, 元/吨)	-206.00	-74.00↓			
上游情况	南非矿:Mn38块:天津港 (日, 元/吨度)	35.00	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)	2320.00	0.00	兰炭 (中料 神木, 日, 元/吨)	1750.00	+50.00↑
	锰矿港口库存 (周, 万吨)	601.60	-3.80↓			
产业情况	锰硅企业开工率 (周, %)	51.23	+5.36↑	硅铁企业开工率 (周, %)	41.96	+0.59↑
	锰硅供应 (周, 吨)	171,514.00	+11704.00↑	硅铁供应 (周, 万吨)	9.90	+0.20↑
	锰硅厂家库存 (半月, 万吨)	23.45	+1.23↑	硅铁厂家库存 (半月, 万吨)	4.56	-0.47↓
	锰硅全国钢厂库存 (月, 天数)	18.69	+0.13↑	硅铁全国钢厂库存 (月, 天数)	17.49	+0.53↑
下游情况	五大钢种锰硅需求 (周, 吨)	146619.00	+554.00↑	五大钢种硅铁需求 (周, 吨)	25394.30	+101.90↑
	全国 247 家钢厂高炉开工率 (周, %)	82.81	+0.40↑	247 家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %)	89.08	+0.76↑
	粗钢产量 (月, 万吨)	8386.80	+243.94↑			
行业消息	1.宝钢股份9月28日在互动平台表示,由于疫情后需求恢复低于预期,6月下旬以来钢价大幅下跌。近期长材价格略有反弹,但薄板材价格起色不大,目前经营环境较为严峻。受疫情影响过后需求反弹和汽车消费刺激政策影响,近期汽车行业持续复苏,后市有望继续恢复性增长,但受芯片短缺等因素影响,仍面临一定不确定性;取向硅钢与新能源汽车用无取向硅钢上半年保持良好态势,下半年需求有望继续提升,无取向硅钢整体需求有望企稳。受全球能源危机、低碳发展以及受环保约束条件的升级影响,煤炭价格虽有波动,总体高位运行。					
	2.9月28日上午9点08分,涟钢210转炉厂3#连铸机正式投产。					
观点总结	锰硅: 锰硅现货价格偏强运行。天津疫情反复,加上内蒙锰矿运费涨价,锰硅成本上行。临近国庆,下游补库需求提升,询单增多。钢招陆续入场,短期需求较强,锰硅成交较好,价格小幅上调,厂家复产意愿有所增加,锰硅供应增速或将加快。钢联数据显示,五大钢材品种库存全部下降,表观需求增加,但由于终端成交一般,钢厂短期或达产量顶点,上涨有限。技术上,锰硅跟随板块共振,SM2301合约宽幅震荡,一小时MACD指标显示绿色动能柱变化不明显, K线在BOLL中轨附近震荡。操作上,建议以震荡思路对待,可布局远期空单。					
	硅铁: 硅铁现货价格偏强运行。成本方面,硅石和电价持稳,由于厂家节前积极备货,兰炭价格再上调,硅铁成本压力增加。宁夏地区硅铁厂家复产意愿较强,短期内或有明显开工提升,硅铁供应增多预期加强,对盘面有一定打压。下游钢厂受节前备货驱动,采购较为积极,询单活跃度增加。钢联数据显示,五大钢材品种库存全部下降,表观需求增加,但钢厂利润仍在相对低位,终端成交未出现明显好转,原料上涨承压。技术上,硅铁跟随黑色板块共振, SF2211合约探底回升,一小时MACD指标显示绿色动能柱收窄, BOLL开口走平。操作上,建议以震荡思路对待,可布局远期空单。					
重点关注	9月30日Mysteel 钢厂开工率及双硅供需情况					

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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!