

撰写人: 蔡跃辉 从业资格证号: F0251444 投资咨询从业证书号: Z0013101

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)	6,586.00	-138.00↓	SF主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,790.00	-208.00↓
	SM主力合约持仓量(日, 手)	153,791.00	-36450.00↓	SF主力合约持仓量(日, 手)	375,210.00	+34799.00↑
	锰硅前20名净持仓(日, 手)	-19,617.00	+17263.00↑	硅铁前20名净持仓(日, 手)	-33,997.00	+5112.00↑
	SM1-9月合约价差(日, 元/吨)	-16.00	+52.00↑	SF1-9月合约价差(日, 元/吨)	-90.00	-8.00↓
现货市场	SM 仓单(日, 张)	10,891.00	-80.00↓	SF 仓单(日, 张)	23,868.00	0.00
	内蒙古锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	6,550.00	0.00	内蒙古硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	6,850.00	-50.00↓
	贵州锰硅FeMn68Si18 (日, 元/吨)	6700.00	0.00	青海硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	6,750.00	-50.00↓
	云南锰硅FeMn68Si18 (日, 元/吨)	6,700.00	0.00	宁夏硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	6,900.00	-50.00↓
	锰硅指数均值(周, 元/吨)	6457.00	-2.00↓	SF 主力合约基差(日, 元/吨)	110.00	+158.00↑
上游情况	SM 主力合约基差(日, 元/吨)	254.00	+138.00↑			
	南非矿:Mn38块·天津港(日, 元/吨度)	31.00	0.00	硅石(98% 西北, 日, 元/吨)	240.00	0.00
	内蒙古乌海二级冶金焦(日, 元/吨)	1720.00	0.00	兰炭(中料神木, 日, 元/吨)	1010.00	0.00
产业情况	锰矿港口库存(周, 万吨)	620.50	+5.40↑			
	锰硅企业开工率(周, %)	60.85	-0.73↓	硅铁企业开工率(周, %)	34.91	+1.08↑
	锰硅供应(周, 吨)	223,433.00	-980.00↓	硅铁供应(周, 万吨)	9.75	+0.17↑
	锰硅厂家库存(半月, 万吨)	25.05	-0.65↓	硅铁厂家库存(半月, 万吨)	7.18	-0.62↓
下游情况	锰硅全国钢厂库存(月, 天数)	16.81	+0.08↑	硅铁全国钢厂库存(月, 天数)	16.78	+0.26↑
	五大钢种锰硅需求(周, 吨)	138271.00	-576.00↓	五大钢种硅铁需求(周, 吨)	23366.30	-71.70↓
	全国 247 家钢厂高炉开工率(周, %)	84.33	-0.15↓	247 家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %)	91.20	-0.91↓
行业消息	粗钢产量(月, 万吨)	9111.00	+98.67↑			
	1.马钢股份预计上半年实现归属于上市公司股东的净利润人民币-22.38亿元左右, 与上年同期相比, 减少人民币36.66亿元左右, 同比减少256.72%左右。2023年上半年, 钢铁行业下游需求恢复不及预期, 钢价低位震荡, 成本端保持相对高位, 钢材价格降幅明显大于铁矿石价格降幅, 钢铁行业盈利空间受到严重挤压。					
观点总结	2.国家统计局发布上半年中国经济数据。初步核算, 上半年国内生产总值593034亿元, 按不变价格计算, 同比增长 5.5%, 比一季度加快 1.0 个百分点。分季度看, 一季度国内生产总值同比增长4.5%, 二季度增长6.3%, 从环比看, 二季度国内生产总值增长0.8%。					更多资讯请关注!
	锰硅: 锰硅市场稳中偏弱运行。供应方面, 主流钢厂招定价低于市场预期, 焦炭继续提涨, 厂家利润压缩明显, 心态悲观, 市场有看跌情绪, 南方厂家接连停产, 山西陕西厂家基本排单生产为主, 锰硅整体开工下滑。宁夏厂家处于亏损边缘, 厂家有低价惜售情绪。下游方面, 钢厂开工高位, 对炉料保持采购刚需; 现货成交弱势, 南方需求偏弱, 厂家盘面出货意愿增强, 套保仓位或有增加, 限制后续涨幅。关注后续钢厂利润和具体行业政策。策略建议: SM2309合约低开低走, 宏观预期博弈加大盘面波动, 操作上建议以日内短线交易, 请投资者注意风险控制。					
重点关注	硅铁: 硅铁市场偏弱运行。供应方面, 钢厂开工保持高位, 对炉料刚需不减, 且部分钢厂为新投高炉备货, 拿货积极性上升, 硅铁厂家开工延续低位回升, 在现有利润水平下继续增加开工将扩大亏损, 预计后续开工持稳。需求方面, 现货成交活跃度不高, 部分地区由于仍在亏损保持低开工, 下游对高价硅铁接受度不高, 社会库存高位, 厂家套保仓位或有增加, 预计短期现货价格震荡持稳, 期货跟随板块走势。策略建议: SF2310合约低开低走, 宏观预期博弈加大盘面波动, 操作上建议以日内短线交易, 请投资者注意风险控制。					更多观点请咨询!