



## 锰硅硅铁产业日报

2022/8/31

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)	7,080.00	-92.00↓	SF主力合约收盘价(日, 元/吨)	7,812.00	-50.00↓
	SM主力合约持仓量(日, 手)	145,060.00	+7955.00↑	SF主力合约持仓量(日, 手)	103,710.00	-10826.00↓
	锰硅前20名净持仓(日, 手)	12,008.00	+2532.00↑	硅铁前20名净持仓(日, 手)	-5,611.00	-404.00↓
	SM1-9月合约价差(日, 元/吨)	-50.00	+28.00↑	SF1-9月合约价差(日, 元/吨)	-38.00	+44.00↑
	SM仓单(日, 张)	22,433.00	-40.00↓	SF仓单(日, 张)	8,421.00	-20.00↓
现货市场	内蒙古锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,100.00	0.00	内蒙古硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,850.00	0.00
	贵州锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7150.00	0.00	青海硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,500.00	0.00
	云南锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,050.00	0.00	宁夏硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,750.00	-300.00↓
	锰硅指数均值(周, 元/吨)	7099.00	-6.00↓	SF主力合约基差(日, 元/吨)	-62.00	-250.00↓
	SM主力合约基差(日, 元/吨)	20.00	+92.00↑			
上游情况	南非矿:Mn38块:天津港(日, 元/吨度)	33.00	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)	2420.00	0.00	兰炭(中料神木, 日, 元/吨)	1700.00	0.00
	锰矿港口库存(周, 万吨)	556.10	-23.00↓			
产业情况	锰硅企业开工率(周, %)	34.32	+0.60↑	硅铁企业开工率(周, %)	38.09	+0.09↑
	锰硅供应(周, 吨)	139,825.00	+735.00↑	硅铁供应(周, 万吨)	9.40	+0.10↑
	锰硅厂家库存(半月, 万吨)	22.20	+0.45↑	硅铁厂家库存(半月, 万吨)	6.17	-0.73↓
	锰硅全国钢厂库存(月, 天数)	18.56	-0.55↓	硅铁全国钢厂库存(月, 天数)	16.96	-2.55↓
下游情况	五大钢种锰硅需求(周, 吨)	134597.00	+744.00↑	五大钢种硅铁需求(周, 吨)	23569.80	+134.20↑
	全国247家钢厂高炉开工率(周, %)	80.14	+2.24↑	247家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %)	85.27	+1.38↑
	粗钢产量(月, 万吨)	8142.86	-930.11↓			
行业消息	1.鞍钢股份2022年上半年实现营业收入702.94亿元, 同比下降2.78%; 实现归属于上市公司股东的净利润17.16亿元, 同比下降67.06%。					
	2.据中物联钢铁物流专业委员会发布的数据, 2022年8月份钢铁行业PMI为46.1%, 环比回升13.1个百分点, 显示钢铁市场连续收紧态势有所放缓, 行业运行有所恢复。					
观点总结	锰硅: 锰硅现货价格弱稳运行。港口锰矿成交弱, 价格持续下行。锰硅厂家成本库存压力较大, 开工仍处相对低位, 8月锰硅厂家开工率环比七月降低, 在停产保价下, 厂家成本有所下降。厂家有低价惜售情绪。成材成交低迷, 钢材表现需求减少, 终端需求偏弱。宏观方面, 美联储加息立场坚定, 市场有担忧情绪。技术上, SM2301合约震荡下行, 一小时MACD指标显示绿色动能柱变化不大, BOLL指标开口扩大, 短期盘面或震荡偏弱。操作建议: 可以区间震荡思路对待, 参考6950-7200元/吨, 止损各60点。					
	硅铁: 硅铁现货价格弱稳运行。原料端, 受神木疫情影响, 煤矿运输效率下降, 兰炭价格上调, 硅铁成本上移。9月钢招在即, 厂家有挺价情绪, 低价出货意愿不高, 市场等待主流钢厂定价指引。高温逐步退场, 前期受温度影响的施工进程有望加速恢复。成材需求一般偏弱, 疫情扰动下复产和成材供应存在不确定性, 贸易商谨慎拿货。技术上, SF2210合约冲高回落, 一小时MACD指标显示绿色动能柱变化不大, BOLL指标显示开口收窄, 期价或震荡止跌。操作建议: 可以区间震荡思路对待, 注意风险控制。					
重点关注						