

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)	6,678.00	-24.00↓	SF主力合约收盘价 (日, 元/吨)	6,848.00	-118.00↓		
	SM主力合约持仓量 (日, 手)	328,699.00	+1944.00↑	SF主力合约持仓量 (日, 手)	387,213.00	+12944.00↑		
	锰硅前20名净持仓 (日, 手)	-30,278.00	-1010.00↓	硅铁前20名净持仓 (日, 手)	-48,467.00	-250.00↓		
	SM1-9月合约价差 (日, 元/吨)	76.00	+54.00↑	SF1-9月合约价差 (日, 元/吨)	-78.00	-6.00↓		
	SM 仓单 (日, 张)	10,006.00	-229.00↓	SF 仓单 (日, 张)	23,815.00	-13.00↓		
现货市场	内蒙古锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	6,500.00	0.00	内蒙古硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	6,900.00	+50.00↑		
	贵州锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	6600.00	0.00	青海硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	6,750.00	0.00		
	云南锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	6,600.00	0.00	宁夏硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	6,900.00	0.00		
	锰硅指数均值 (周, 元/吨)	6447.00	-10.00↓	SF 主力合约基差 (日, 元/吨)	-66.00	+42.00↑		
	SM 主力合约基差 (日, 元/吨)	-202.00	0.00					
上游情况	南钢矿: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)	1670.00	0.00	兰炭 (中料神木, 日, 元/吨)	1010.00	0.00		
	锰矿港口库存 (周, 万吨)	602.30	-18.20↓					
产业情况	锰硅企业开工率 (周, %)	60.27	-0.58↓	硅铁企业开工率 (周, %)	34.35	-0.56↓		
	锰硅供应 (周, 吨)	222,992.00	-441.00↓	硅铁供应 (周, 万吨)	9.86	+0.11↑		
	锰硅厂家库存 (半月, 万吨)	22.13	-2.92↓	硅铁厂家库存 (半月, 万吨)	7.21	+0.03↑		
	锰硅全国钢厂库存 (月, 天数)	16.73	-0.08↓	硅铁全国钢厂库存 (月, 天数)	16.46	-0.32↓		
下游情况	五大钢种锰硅需求 (周, 吨)	139280.00	+1009.00↑	五大钢种硅铁需求 (周, 吨)	23523.60	+157.30↑		
	全国 247 家钢厂高炉开工率 (周, %)	83.60	-0.73↓	247 家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %)	91.16	-0.04↓		
	粗钢产量 (月, 万吨)	9111.04	+98.71↑					
行业消息	1.2023年第28周 (7月8-14日) 陕西省钢材均价4236.9元/吨, 基期价4251.4元/吨, 环比下跌0.3%。7月的陕西高温天气仍在持续, 钢材需求释放无明显改观, 供应仍处于高位, 钢材价格围绕成本小幅波动。							
	2.据湖南省商务厅对全省生产资料流通市场监测数据显示, 2023年第29周 (7月10-16日), 全省钢材销售均价4330.37元/吨, 环比下跌0.1%, 同比下跌7.9%。钢材市场总体呈现供需双弱、热点明显缺乏的特征。							更多资讯请关注!
观点总结	锰硅: 锰硅市场偏强运行。原料方面, 锰矿价格探底, 下游厂家压价采购, 现货成交一般, 化工焦有续涨预期, 叠加内蒙拉矿运费上行, 原料成本上移, 现货支撑抬升, 厂家在盈利情况下保持生产, 个别工厂检修即将结束, 后续供应或将继续小幅增加。需求方面, 在下游的提振下, 锰硅成交有所好转, 厂家盘面套保操作增多, 宏观利好提振交易情绪, 市场信心修复, 关注后政策方向对产业链供需的影响。策略建议: SM2310合约冲高回落, 操作上建议以震荡思路对待, 关注上方6750附近压力, 请投资者注意风险控制。							
	硅铁: 硅铁市场稳中偏弱运行。原料方面, 兰炭硅石持稳。供应方面, 硅铁现货市场观望情绪蔓延, 现货价格波动不大, 青海厂家盈利情况较好, 其余大部分在盈亏边缘, 厂家开工变动不大。需求方面, 铁水日产高位, 钢厂去库效率提升, 保持盈利, 下游贸易商进行刚需补库, 钢招提前入场, 近期受宏观利好提振黑色整体震荡偏强, 市场投机需求增加, 但在淡季行情的限制下反弹高度有限, 预计盘面偏震荡, 关注后政策方向对黑色产业链的指引。策略建议: SF2310合约震荡下行, 操作上建议以震荡思路对待, 关注下方6750附近支撑, 请投资者注意风险控制。							
重点关注								

