

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)	7,338.00	+154.00↑	SF主力合约收盘价 (日, 元/吨)	7,950.00	+94.00↑
	SM主力合约持仓量 (日, 手)	141,078.00	-4316.00↓	SF主力合约持仓量 (日, 手)	127,864.00	-11795.00↓
	锰硅前20名净持仓 (日, 手)	11,805.00	-3454.00↓	硅铁前20名净持仓 (日, 手)	-10,091.00	-6603.00↓
	SM1-9月合约价差 (日, 元/吨)	-146.00	+2.00↑	SF1-9月合约价差 (日, 元/吨)	-300.00	+66.00↑
现货市场	SM 仓单 (日, 张)	22,794.00	-523.00↓	SF 仓单 (日, 张)	7,846.00	-80.00↓
	内蒙古锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,300.00	0.00	内蒙古硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,750.00	0.00
	贵州锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7300.00	0.00	青海硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,500.00	0.00
	云南锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,100.00	0.00	宁夏硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,600.00	0.00
	锰硅指数均值 (周, 元/吨)	7388.00	-297.00↓	SF 主力合约基差 (日, 元/吨)	-256.00	-156.00↓
上游情况	SM 主力合约基差 (日, 元/吨)	116.00	+6.00↑			
	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	-200.00↓	兰炭 (中料神木, 日, 元/吨)	1600.00	0.00
产业情况	锰矿港口库存 (周, 万吨)	534.10	+31.30↑			
	锰硅企业开工率 (周, %)	33.07	-3.56↓	硅铁企业开工率 (周, %)	39.64	-7.62↓
	锰硅供应 (周, 吨)	142,485.00	-10570.00↓	硅铁供应 (周, 万吨)	9.30	-2.27↓
	锰硅厂家库存 (半月, 万吨)	21.97	-1.51↓	硅铁厂家库存 (半月, 万吨)	5.92	+0.15↑
下游情况	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↓
	五大钢种锰硅需求 (周, 吨)	126434.00	-4478.00↓	五大钢种硅铁需求 (周, 吨)	21448.20	-752.50↓
	全国 247 家钢厂高炉开工率 (周, %)	73.16	-3.82↓	247 家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %)	81.40	-2.61↓
行业消息	粗钢产量 (月, 万吨)	9072.97	-588.33↓			
	1.中钢协: 前期部分推迟订单陆续发出, 导致6月出口量维持在高位, 但钢材出口已呈现回落态势。展望下半年, 全球经济面临高通胀、低增长压力, 主要经济制造业扩张明显放缓, 海外需求整体趋弱, 价格同步大幅下挫, 6月底欧盟热轧卷板出厂价较俄乌冲突爆发前仍有17.8%的下跌。海内外价差随全球供应链的恢复大幅收窄, 如独联体等区域报价已经低于我国, 国内钢材价格优势不明显, 5月份起出口订单量已明显下滑, 接单周期相应拉长, 预计后期钢材出口将呈现递减态势。					更多资讯请关注!
观点总结	2.据国家统计局7月27日最新公布数据显示, 2022年1-6月, 黑色金属冶炼和压延加工业实现营业收入45759.7亿元, 同比下降3.6%; 营业成本43326.5亿元, 同比增长0.7%; 实现利润总额826.1亿元, 同比下降68.7%。					更多观点请咨询!
	锰硅: 锰硅现货价格偏弱运行。锰矿持续沉降, 需求明显不足, 钦州物流受限。硅锰期货暂时止跌, 厂家亏损持续, 停产加剧, 市场成交一般, 谨慎采购。钢厂限产下, 总产量下滑, 大幅去库, 利润有所修复, 需求边际好转, 但高温叠加消费淡季, 整体需求低迷。市场信心恢复缓慢。宏观面转好, 美联储加息75点符合市场预期, 市场心态企稳, 经历超跌后盘面小幅反弹。技术上, SM2209合约跳空高开, 一小时MACD指标显示红色动能柱小幅扩大, 关注BOLL上轨压力。操作建议, 可尝试在7100-7400区间低吸高抛, 止损各60点。					
	硅铁: 硅铁现货价格偏弱运行。兰炭价格下调, 成本下移动, 硅铁成交情况一般。高温淡季, 终端需求恢复缓慢, 港口仓库钢坯小幅累库, 钢市趋弱整理, 去库缓慢; 钢厂限产, 钢材总产量下滑, 利润略有修复。金属镁市场弱稳运行, 工厂低价出货意愿有限。唐山钢坯直发成交偏可, 下游成品材价格趋强运行, 整体成交尚可, 市场情绪好转, 带动盘面止跌小幅反弹。技术上, SF2209合约跳空高开, 一小时MACD指标显示红色动能柱变化不大, 关注均线支撑。操作建议: 可尝试在7995附近短线做空, 止损参考:8060元/吨。					
重点关注	7月29日Mysteel 双硅库存及供需情况					

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