

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）	7,384.00	0.00	SF主力合约收盘价（日，元/吨）	7,910.00	-152.00↓
	SM主力合约持仓量（日，手）	98,870.00	-7719.00↓	SF主力合约持仓量（日，手）	72,749.00	-10851.00↓
	锰硅前20名净持仓（日，手）	-756.00	-705.00↓	硅铁前20名净持仓（日，手）	-10,712.00	-2170.00↓
	SM1-9月合约价差（日，元/吨）	0.00	+22.00↑	SF1-9月合约价差（日，元/吨）	-66.00	+66.00↑
	SM 仓单（日，张）	23,186.00	-33.00↓	SF 仓单（日，张）	8,216.00	-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）	7200.00	0.00	青海硅铁 FeSi75-B（日，元/吨）	7,600.00	0.00
	云南锰硅FeMn68Si18（日，元/吨）	7,050.00	0.00	宁夏硅铁 FeSi75-B（日，元/吨）	7,800.00	0.00
	锰硅指数均值（周，元/吨）	7114.00	-83.00↓	SF 主力合约基差（日，元/吨）	-110.00	+152.00↑
	SM 主力合约基差（日，元/吨）	-284.00	0.00			
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）	2420.00	+200.00↑	兰炭（中料 神木，日，元/吨）	1550.00	0.00
	锰矿港口库存（周，万吨）	566.70	+6.40↑			
产业情况	锰硅企业开工率（周，%）	34.37	+1.79↑	硅铁企业开工率（周，%）	40.17	+0.52↑
	锰硅供应（周，吨）	139,580.00	+770.00↑	硅铁供应（周，万吨）	9.60	+0.20↑
	锰硅厂家库存（半月，万吨）	21.75	-3.39↓	硅铁厂家库存（半月，万吨）	6.90	+0.30↑
	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↓
下游情况	五大钢种锰硅需求（周，吨）	131652.00	+1946.00↑	五大钢种硅铁需求（周，吨）	22699.20	+405.90↑
	全国 247 家钢厂高炉开工率（周，%）	76.24	+3.54↑	247 家钢厂高炉炼铁产能利用率(周，%)	81.22	+1.62↑
	粗钢产量（月，万吨）	8143.00	-929.97↓			
行业消息	1.8月12日，柳钢热轧板带厂1450加热炉1号炉停炉检修任务，并成功点火投产。					
	2.中信特钢（000708）近日发布2022年半年度报告，报告期内公司实现营业收入51,821,836,641.68元，同比增长5.57%；归属于上市公司股东的净利润3,776,900,591.28元，同比下滑9.81%。					
观点总结	锰硅：锰硅现货价格弱稳运行。进口锰矿交投氛围偏弱，成交松动，价格下调。锰硅现货需求略增。锰硅厂家开工率小幅上涨，前期停产下有效小幅去库，但厂家仍处亏损，库存成本压力仍存。焦炭开启二轮提涨，钢厂成本上行，用电安排影响供给，或影响钢厂开工，加上目前宏观需求一般，下行压力仍存，下游复产预期减弱。技术上，SM2209合约震荡运行，一小时MACD指标显示红色动能柱收窄，变为绿色动能柱，多方力量减弱。操作建议：可尝试轻仓短空，注意风险控制。					
	硅铁：硅铁现货价格暂稳运行。兰炭价格暂稳。硅铁开工微增，但整体仍处亏损，高成本高库存压力仍存，厂家低价出货意愿较低，出货表现一般。目前盘面处于高位，下游贸易商操作空间有限，压价采购心态较突出。焦炭开启二轮提涨，钢材成本上升，利润压缩。钢价价格下探，市场观望情绪浓，需求表现一般。宏观经济指标显示下行压力较大，加上局部区域用电安排影响供给，钢厂复产或受影响，原料需求承压。技术上，SF2209合约震荡下行，一小时MACD指标显示红色动能柱变为绿色动能柱，DIFF与DEA向下交叉，空方力量较强。操作建议：可以尝试在7935附近轻仓做空，止损参考8030元/吨。					
重点关注						

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

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