

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)	7,436.00	+106.00↑	SF主力合约收盘价(日, 元/吨)	8,240.00	+254.00↑			
	SM主力合约持仓量(日, 手)	127,208.00	-7847.00↓	SF主力合约持仓量(日, 手)	130,019.00	+2972.00↑			
	锰硅前20名净持仓(日, 手)	6,927.00	-3216.00↓	硅铁前20名净持仓(日, 手)	-3,376.00	+4254.00↑			
	SM1-9月合约价差(日, 元/吨)	-140.00	-16.00↓	SF1-9月合约价差(日, 元/吨)	-296.00	-22.00↓			
	SM仓单(日, 张)	22,875.00	-61.00↓	SF仓单(日, 张)	7,767.00	0.00			
现货市场	内蒙古锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,300.00	0.00	内蒙古硅铁FeSi75-B (日, 元/吨)	7,950.00	+200.00↑			
	贵州锰硅FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7300.00	0.00	青海硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,650.00	+100.00↑			
	云南锰硅FeMn68Si18 (日, 元/吨)	7,100.00	0.00	宁夏硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨)	7,800.00	+100.00↑			
	锰硅指数均值(周, 元/吨)	7216.00	-172.00↓	SF主力合约基差(日, 元/吨)	-440.00	-154.00↓			
	SM主力合约基差(日, 元/吨)	-136.00	-106.00↓						
上游情况	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	0.00	兰炭(中料神木, 日, 元/吨)	1600.00	0.00			
	锰矿港口库存(周, 万吨)	534.10	+31.30↑						
产业情况	锰硅企业开工率(周, %)	30.12	-2.95↓	硅铁企业开工率(周, %)	38.97	-0.67↓			
	锰硅供应(周, 吨)	132,895.00	-9590.00↓	硅铁供应(周, 万吨)	9.10	-0.20↓			
	锰硅厂家库存(半月, 万吨)	25.14	+3.17↑	硅铁厂家库存(半月, 万吨)	6.60	+0.68↑			
	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)	126690.00	+256.00↑	五大钢种硅铁需求(周, 吨)	21516.50	+68.30↑			
	全国247家钢厂高炉开工率(周, %)	71.61	-1.55↓	247家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %)	79.30	-2.10↓			
	粗钢产量(月, 万吨)	9072.97	-588.33↓						
行业消息	1.据Mysteel不完全统计, 截至8月1日, 国内14家钢厂发布检修计划。其中, 本钢计划8月10日-9月20日停产升级改造小棒生产线, 预计影响Φ35-80圆钢产量4.5万吨。								
	2.据中国钢铁工业协会统计数据显示, 2022年上半年, 会员钢铁企业实现营业收入33390亿元, 同比下降4.65%; 营业成本30710亿元, 同比下降0.18%, 成本降幅小于营业收入降幅4.47个百分点; 利润总额1034亿元, 同比下降55.47%; 平均销售利润率3.10%, 同比下降3.53个百分点。					更多资讯请关注!			
观点总结	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, 采购谨慎。钢厂限产持续, 铁水粗钢产量下滑, 去库明显, 利润有所修复, 需求边际好转; 焦炭五轮提降落地, 钢厂成本端压力缓解, 复产高炉增多。上周末唐山钢坯涨价130元, 整体成交仍偏弱, 但市场心态有所好转。技术上, SM2209合约震荡偏强, 一小时MACD指标显示红色动能柱收窄, 关注BOLL指标上轨压力。操作建议, 可尝试在7400附近短线做多, 止损参考7320元/吨。					更多观点请咨询!			
	硅铁: 硅铁现货价格偏弱运行。兰炭厂家累库压力不减, 出货不畅, 四轮提降开启, 成本下移。硅铁期货上涨, 现货跟涨, 市场成交情况一般, 下游以观望为主。高温淡季, 终端需求恢复缓慢。周末唐山钢坯价格上行, 钢材需求边际好转, 复产高炉增多, 复产意愿增加。金属镁市场弱势运行, 市场观望为主。技术上, SF2209合约高开高走, 一小时MACD指标显示红色动能柱变化不大, 关注BOLL指标上轨压力。操作建议: 可尝试在8195附近短线做多, 止损参考8105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								