

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) | 7,410.00 | +10.00↑ | SF主力合约收盘价 (日, 元/吨) | 8,286.00 | -112.00↓ |
| | SM主力合约持仓量 (日, 手) | 121,344.00 | +58.00↑ | SF主力合约持仓量 (日, 手) | 135,559.00 | -8552.00↓ |
| | 锰硅前20名净持仓 (日, 手) | -4,937.00 | +4572.00↑ | 硅铁前20名净持仓 (日, 手) | -3,338.00 | +3023.00↑ |
| | SM5-1月合约价差 (日, 元/吨) | -84.00 | +6.00↑ | SF5-1月合约价差 (日, 元/吨) | -184.00 | +38.00↑ |
| | SM 仓单 (日, 张) | 4,023.00 | +600.00↑ | SF 仓单 (日, 张) | 3,314.00 | -182.00↓ |
| 现货市场 | 内蒙古锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨) | 7,200.00 | 0.00 | 内蒙古硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨) | 8,300.00 | 0.00 |
| | 贵州锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨) | 7250.00 | 0.00 | 青海硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨) | 8,150.00 | 0.00 |
| | 云南锰硅 FeMn68Si18 (日, 元/吨) | 7,250.00 | 0.00 | 宁夏硅铁 FeSi75-B (日, 元/吨) | 8,300.00 | 0.00 |
| | 锰硅指数均值 (周, 元/吨) | 7142.00 | -4.00↓ | SF 主力合约基差 (日, 元/吨) | 14.00 | +112.00↑ |
| | SM 主力合约基差 (日, 元/吨) | -210.00 | -10.00↓ | | | |
| 上游情况 | 南钢矿:Mn38块:天津港 (日, 元/吨度) | 34.00 | 0.00 | 硅石 (98% 西北, 日, 元/吨) | 250.00 | 0.00 |
| | 内蒙古乌海二级冶金焦 (日, 元/吨) | 2220.00 | 0.00 | 兰炭 (中料神木, 日, 元/吨) | 1480.00 | 0.00 |
| | 锰矿港口库存 (周, 万吨) | 613.30 | -6.60↓ | | | |
| 产业情况 | 锰硅企业开工率 (周, %) | 59.86 | +0.88↑ | 硅铁企业开工率 (周, %) | 44.76 | +1.20↑ |
| | 锰硅供应 (周, 吨) | 196,266.00 | +1274.00↑ | 硅铁供应 (周, 万吨) | 11.45 | +0.76↑ |
| | 锰硅厂家库存 (半月, 万吨) | 18.51 | -0.35↓ | 硅铁厂家库存 (半月, 万吨) | - | - |
| | 锰硅全国钢厂库存 (月, 天数) | 16.96 | -1.84↓ | 硅铁全国钢厂库存 (月, 天数) | 17.68 | +0.36↑ |
| 下游情况 | 五大钢种锰硅需求 (周, 吨) | 137446.00 | -1868.00↓ | 五大钢种硅铁需求 (周, 吨) | 23495.30 | -103.20↓ |
| | 全国 247 家钢厂高炉开工率 (周, %) | 77.03 | +0.68↑ | 247 家钢厂高炉炼铁产能利用率(周, %) | 82.52 | -0.84↓ |
| | 粗钢产量 (月, 万吨) | 7975.90 | -719.00↓ | | | |
| 行业消息 | 1.据中物联钢铁物流专业委员会发布的数据, 2022年11月份钢铁行业PMI为40.1%, 环比下降4.2个百分点, 连续2个月环比下降, 钢铁行业承压运行。 | | | | | |
| | 2.近日, 印度财政部发布下调铁矿石出口关税文件, 取消了对部分钢铁中间产品征收的15%出口关税, 涉及到不锈钢、板材等, 同时还下调了高品位铁矿石关税, 该调整自印度时间11月19日生效。对此, 中国钢铁工业协会(简称中钢协)今日表示, 印度出口资源将重新抢占国际市场, 尽管短期内影响有限, 但明年或将对我国钢铁产品出口造成一定冲击。 | | | | |  更多资讯请关注! |
| 观点总结 | 锰硅: 锰硅现货价格暂稳运行。原料端, 锰矿报价上探; 焦炭价格与运费齐涨, 锰硅北方主产区即期生产成本增幅明显, 厂家多处亏损边缘, 挺价意愿强。需求方面, 河钢发布12月锰硅钢招量20600吨, 环比11月增加6400吨, 增幅明显, 短期有望提振需求, 钢招定价仍在观望。技术上, SM2301合约震荡整理, 一小时BOLL指标显示开口收窄。操作上, 建议以震荡思路对待。 | | | | |  更多观点请咨询! |
| | 硅铁: 硅铁现货暂稳运行。原料端, 兰炭价格下调, 硅铁成本再度下移, 同时现货支撑减弱; 厂家利润修复, 生产积极性提升。需求方面, 主要钢厂入场采购, 河钢发布12月硅铁招标量1399吨, 环比11月增350吨, 厂家现货偏紧, 有惜售情绪。宏观暖风频吹, 释放一定市场需求, 黑色产业链利润或小幅修复, 但基本面供需矛盾不突出, 对冬储不确定性较强, 市场观望增加, 盘面波动反复。技术上, SF2301合约高开低走, 一小时BOLL指标显示K线下穿中轨, 开口收窄。操作上, 建议区间交易, 参考8100-8450。 | | | | | |
| 重点关注 12月2日Mysteel 双硅供需及厂家开工率 | | | | | | |
| 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 | | | |