

工业硅日报：现货价格全线下挫 期货价格大幅收跌

2023 年 10 月 26 星期四

一、每日数据监测

金石期货 JINSHI FUTURES			工业硅期货日度数据监测					
指标			截止	单位	上一日	今日	涨跌量	涨跌幅
期货	SI2312 (主力)	收盘价	2023/10/26	元/吨	14440	14150	-290	-2.01%
		成交量	2023/10/26	手	49038	72894	23856	48.65%
		持仓量	2023/10/26	手	68868	72215	3347	4.86%
	SI2401价格		2023/10/26	元/吨	14510	14210	-300	-2.07%
	SI2402价格		2023/10/26	元/吨	14540	14270	-270	-1.86%
	SI2403价格		2023/10/26	元/吨	14655	14315	-340	-2.32%
现货	不通氧5530 (华东)		2023/10/26	元/吨	14550	14450	-100	-0.69%
	通氧5530 (华东)		2023/10/26	元/吨	15250	15150	-100	-0.66%
	4210 (华东)		2023/10/26	元/吨	15950	15900	-50	-0.31%
价差	基差	SI2312基差	2023/10/26	元/吨	110	300	190	172.73%
		SI2401基差	2023/10/26	元/吨	110	300	190	172.73%
		SI2402基差	2023/10/26	元/吨	10	180	170	1700.00%
		SI2403基差	2023/10/26	元/吨	-105	135	240	-228.57%
		01-02价差	2023/10/26	元/吨	-100	-120	-20	20.00%
		01-03价差	2023/10/26	元/吨	-215	-165	50	-23.26%

数据来源：wind，文华财经，金石期货研究所

二、行业相关信息概览

1、芯片市场复苏迹象初显：SK 海力士三季度营收降幅开始放缓。①韩国内存芯片制造商 SK 海力士第三季度营收下滑 17%，与前两季度相比较为温和；②SK 海力士还表示，2024 年的资本支出将比今年增加；③该公司称，在做出减产决定后，芯片价格正在企稳。

2、SMM 华东工业硅价格下调，SMM 华东不通氧 553#在 14400-14500 元/吨，均价下调 100 元/吨。通氧 553#在 15100~15200 元/吨，均价下调 100 元/吨。521#在 15400~15500 元/吨，均价下调 100 元/吨。441#在 15400~15600 元/吨，均价下调 50 元/吨。421#在 15800~16000 元/吨，均价下调 50 元/吨。421#有机硅用在 16200-16400 元/吨，均价下调 50 元/吨。3303#在 15900-16200 元/吨，均价下调 50 元/吨。昆明、黄埔港、天津港、四川地区硅

价下调。新疆地区部分硅价小幅走低。福建地区硅价持稳。97 硅今日部分规格价格小幅走低。

3、国家能源局：9 月光伏新增装机 16.78GW 1-9 月累计装机 128.94GW，国家能源局发布 1-9 月份全国电力工业统计数据。其中，9 月光伏新增装机 16.78GW,1-9 月光伏累计装机 128.94GW。截至 9 月底，全国累计发电装机容量约 27.9 亿千瓦，同比增长 12.3%。其中，太阳能发电装机容量约 5.2 亿千瓦，同比增长 45.3%；风电装机容量约 4.0 亿千瓦，同比增长 15.1%。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

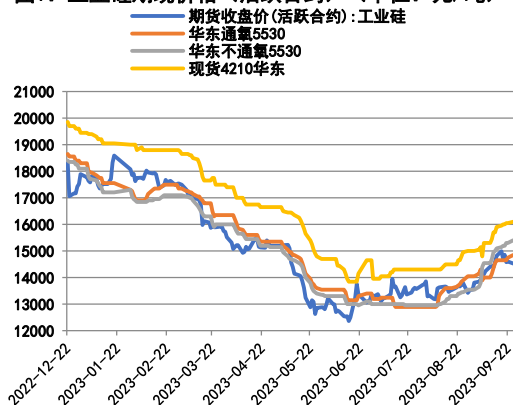


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

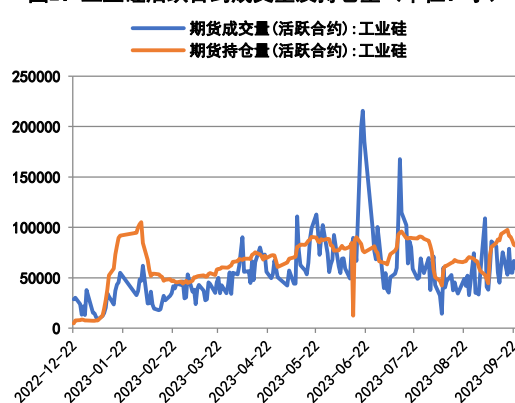


图3：基差（S10）

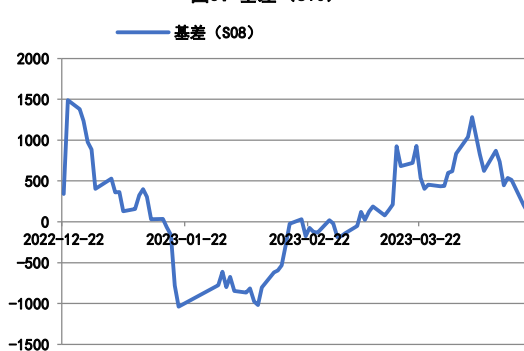
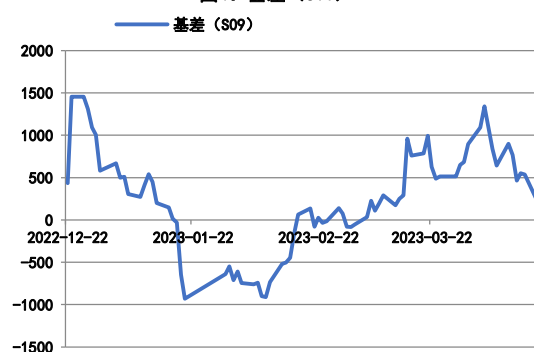
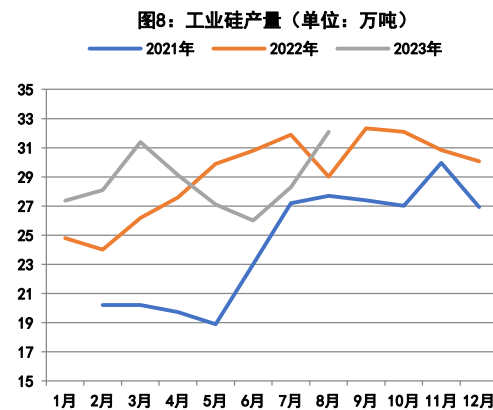
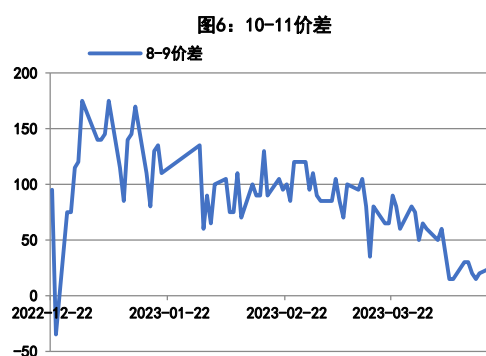
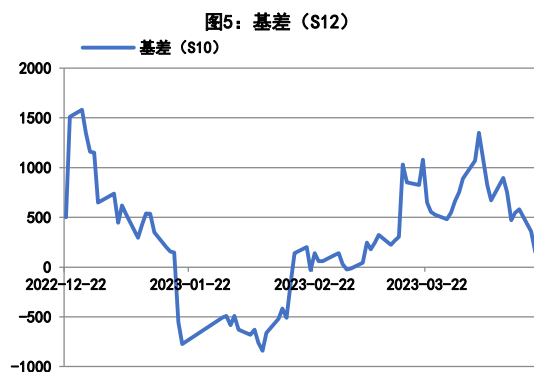


图4：基差（S11）





数据来源: 文华财经、上海有色网、金石期货研究所

四、行情展望

2023年10月26星期四,工业硅期货大幅下挫,主力合约收跌2.55%至14150元/吨。受工业硅及光伏产业链现货价格疲软拖累。工业硅现货价格跌幅不断扩大,多晶硅价格也大幅下跌,光伏产业链价格持续走弱。目前西南地区即将进入枯水期,电价上涨,成本增加,后期部分工厂可能会停产。现货方面,工业硅现货价格全面下挫。下游需求端,有机硅下游按需备货为主,交投情况一般,后期存看跌心态。多晶硅价格止跌企稳,光伏产业链价格持续走弱,市场成交情况一般,对于工业硅需求较为稳定。铝合金价格偏弱运行,下游观望心态延续,市场交投氛围冷清。总体来看,工业硅市场成交略有不足,气氛较为冷清,但近期成本可能上涨,预计对于工业硅价格形成一定支撑。



金石期货公众号



金石期货投资咨询部公众号

钱龙 期货从业资格号：F3077614；投资咨询证书号：Z0017608

免责声明：

本报告中的信息均来源于已公开的资料，尽管我们相信报告中资料来源的可靠性，但我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。也不保证我公司所做出的意见和建议不会发生任何的变更，在任何情况下，我公司报告中的信息和所表达的意见和建议以及所载的数据、工具及材料均不能作为您所进行期货买卖的绝对依据。由于报告在编写时融入了该分析师个人的观点和见解以及分析方法，如与金石期货公司发布的其他信息有不一致及有不同的结论，未免发生疑问，本报告所载的观点并不代表了金石期货公司的立场，所以请谨慎参考。我公司不承担因根据本报告所进行期货买卖操作而导致的任何形式的损失。

另外，本报告所载资料、意见及推测只是反映金石期货公司在本报告所载明的日期的判断，可随时修改，毋需提前通知。未经金石期货公司允许批准，本报告内容不得以任何范式传送、复印或派发此报告的材料、内容或复印本予以任何其他人，或投入商业使用。如遵循原文本意的引用、刊发，需注明出处“金石期货有限公司”，并保留我公司的一切权利。