

工业硅日报：期货价格震荡下挫 市场整体情绪偏弱

2023 年 11 月 1 星期三

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	2023/11/1	元/吨	14260	13990	-270	-1.89%
		成交量	2023/11/1	手	42621	34404	-8217	-19.28%
		持仓量	2023/11/1	手	60616	51807	-8809	-14.53%
	SI2401价格		2023/11/1	元/吨	14335	14060	-275	-1.92%
	SI2402价格		2023/11/1	元/吨	14380	14120	-260	-1.81%
	SI2403价格		2023/11/1	元/吨	14460	14145	-315	-2.18%
现货	不通氧5530 (华东)		2023/11/1	元/吨	14400	14400	0	0.00%
	通氧5530 (华东)		2023/11/1	元/吨	15100	15100	0	0.00%
	4210 (华东)		2023/11/1	元/吨	15850	15750	-100	-0.63%
价差	基差	SI2312基差	2023/11/1	元/吨	140	410	270	192.86%
		SI2401基差	2023/11/1	元/吨	140	410	270	192.86%
		SI2402基差	2023/11/1	元/吨	20	280	260	1300.00%
		SI2403基差	2023/11/1	元/吨	-60	255	315	-525.00%
		01-02价差	2023/11/1	元/吨	-120	-130	-10	8.33%
		01-03价差	2023/11/1	元/吨	-200	-155	45	-22.50%

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、缅甸边境冲突影响 云南进口木炭紧缺，缅北腊戍、贵慨等多地的缅甸军事据点遭武装袭击并爆发交火，战事激烈。受冲突事件影响，云南地区近期木炭进口也大幅缩减，木炭紧缺加剧。

2、SMM 华东部分工业硅价格下调。11 月 1 日，SMM 华东不通氧 553#在 14300-14500 元/。通氧 553#在 15000~15200 元/吨。521#在 15300~15500 元/吨，均价下调 50 元/吨。441#在 15300~15500 元/吨，均价下调 50 元/吨。421#在 15700~15800 元/吨，均价下调 100 元/吨。421#有机硅用在 16100-16200 元/吨，均价下调 150 元/吨。3303#在 15900-16100 元/吨。昆明、黄埔港、天津港、四川地区部分硅价下调。新疆地区硅石价格全线下调。上海、福建地区硅价持稳。再生硅价格下调。

3、根据云南省电力负荷管理中心及云南电力调度控制中心文件，发布关于“启动非铝耗能行业负荷管理的通知”，为确保今冬明春电力可靠供应和电网安全稳定运行，要求德宏州产业主管部门批复的企业清单及负荷管理的有关要求，确保 2023 年 11 月 5 日 24：00 前实施负荷管理规模不低于 18.75 万千瓦。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

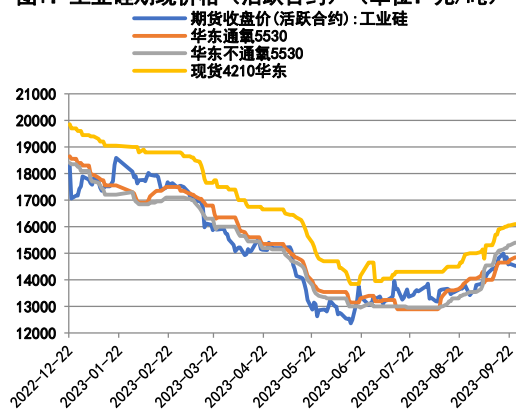


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

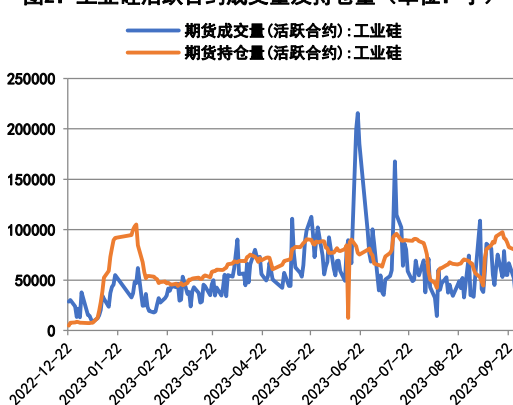


图3：基差（S10）

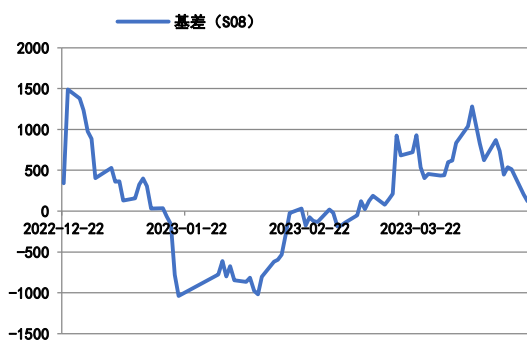


图4：基差（S11）

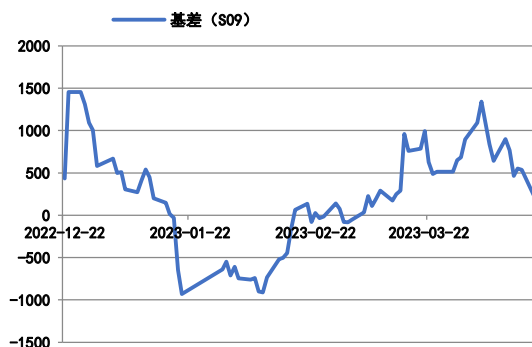


图5：基差（S12）

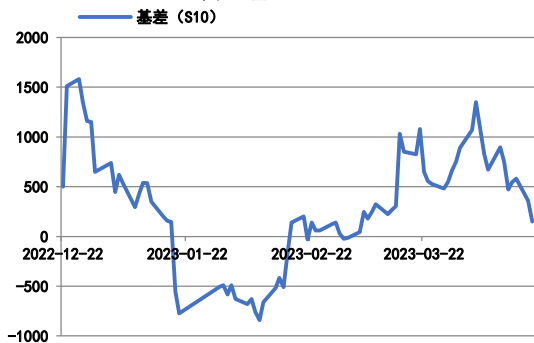


图6：10-11价差

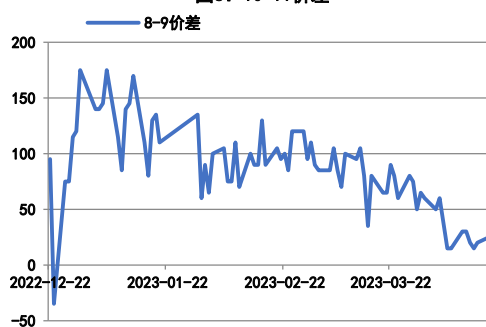


图7：10-12价差

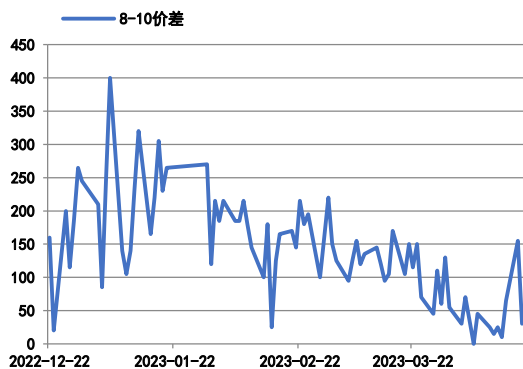
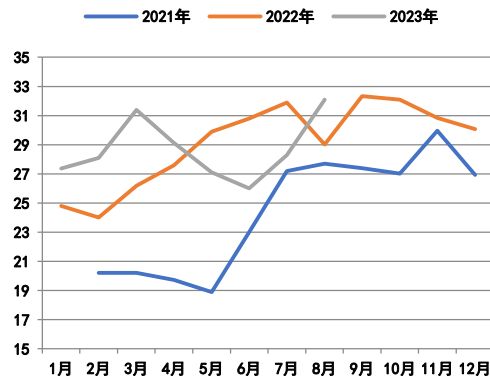


图8：工业硅产量（单位：万吨）



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 11 月 1 星期三,工业硅期货震荡下挫,主力合约收跌 1.51%至 13990 元/吨。目前西南地区进入枯水期,电价上涨,部分厂家停炉减产。西北地区大厂目前正在逐步复产中,新疆地区开工率有所提升,十一月开始工业硅生产主要以新疆及内蒙为主。现货方面,工业硅现货价格稳中有跌。下游需求端,有机硅下游按需备货为主,交投情况一般,市场悲观情绪较浓。多晶硅价格止跌企稳,光伏产业链价格持续走弱,终端需求萎靡。铝合金价格维持稳定,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,预计短期对于工业硅价格形成一定支撑。

关注金石期货微信公众号



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。