

工业硅日报：期价偏强震荡 供应格局偏紧

2024年1月2 星期二

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	SI2402 (主力)	收盘价	2024/1/2	元/吨	14160	14365	205	1.45%
		成交量	2024/1/2	手	23642	32580	8938	37.81%
		持仓量	2024/1/2	手	60603	59117	-1486	-2.45%
	SI2403价格		2024/1/2	元/吨	14230	14430	200	1.41%
	SI2404价格		2024/1/2	元/吨	14275	14465	190	1.33%
现货	不通氧5530 (华东)		2024/1/2	元/吨	15100	15100	0	0.00%
	通氧5530 (华东)		2024/1/2	元/吨	15600	15600	0	0.00%
	4210 (华东)		2024/1/2	元/吨	15850	15850	0	0.00%
价差	SI2402基差		2024/1/2	元/吨	940	735	-205	-21.81%
	SI2403基差		2024/1/2	元/吨	870	670	-200	-22.99%
	SI2404基差		2024/1/2	元/吨	825	635	-190	-23.03%
	02-03价差		2024/1/2	元/吨	-70	-65	5	-7.14%
	02-04价差		2024/1/2	元/吨	-115	-100	15	-13.04%

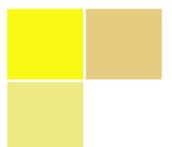
数据来源：wind，文华财经，金石期货研究所

二、行业相关信息概览

1、SMM 华东工业硅价格持稳，SMM 华东不通氧 553#在 15000-15200 元/吨。通氧 553#在 15500~15700 元/吨。521#在 15600~15800 元/吨。441#在 15700-15800 元/吨。421#在 15800~15900 元/吨。421#有机硅用在 16300-16400 元/吨。3303#在 15800-16000 元/吨。昆明、黄埔港、天津港、新疆、四川、福建、上海地区硅价持稳。再生硅和 97 硅今日价格同样持稳运行。

2、包头：1-11 月多晶硅产量同比增长 2.6 倍 稀有稀土金属矿产量同比增长 1.2 倍：1-11 月份，包头市规模以上工业增加值同比增长 22.8%。分主要产品看，1-11 月份，规模以上工业 30 种主要产品（不包括能源产品）中有 21 种实现同比增长。其中，多晶硅产量同比增长 2.6 倍，单晶硅增长 59.3%。

3、北方多地重污染天气应急响应 新疆硅企减产范围扩大开工率走弱，新疆样本硅企（产能占比 79%）周度产量在 25680 吨，周度开工率在 68%，环比下降。



云南样本硅企（产能占比 30%）周度产量在 3850 吨，周度开工率在 45%，较上周持平。四川样本硅企（产能占比 32%）周度产量在 1635 吨，周度开工率在 25%，周环比持平。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价走势

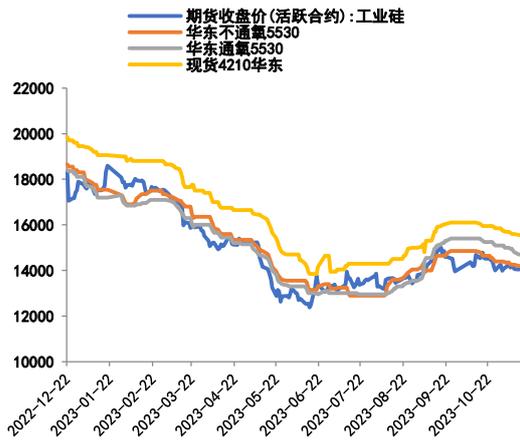


图2：工业硅期货成交量及持仓量

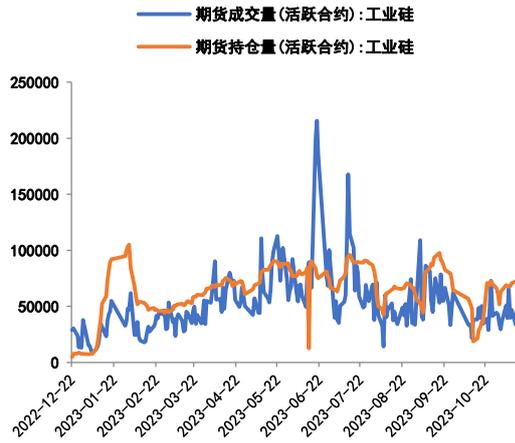


图3：工业硅期货合约S2401基差

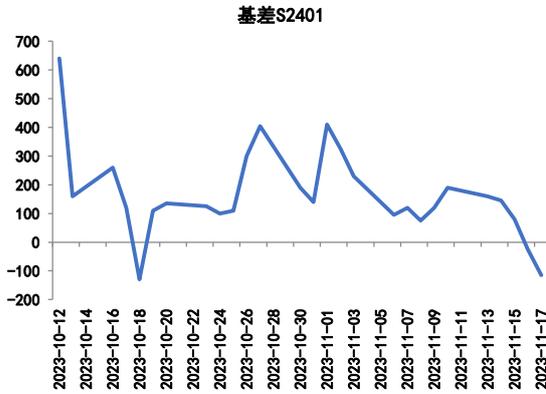


图4：工业硅期货合约S2402基差

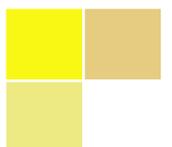
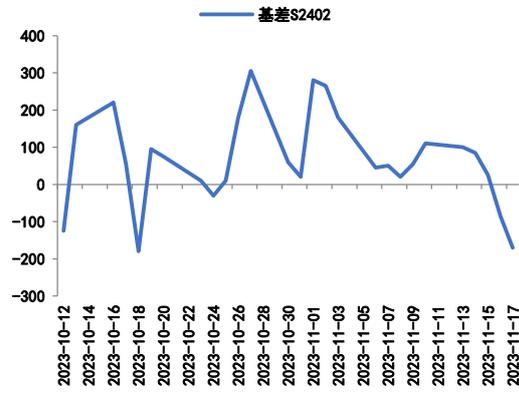


图5：工业硅期货合约S2403基差

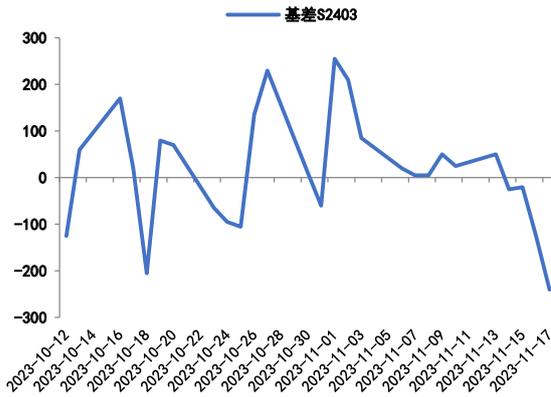


图6：工业硅期货合约S2401—S2402价差

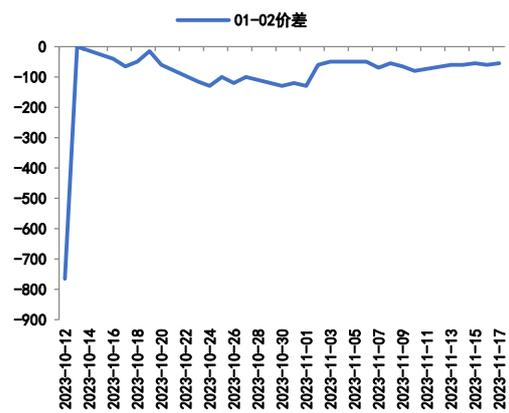


图7：工业硅期货合约S2401—S2403价差

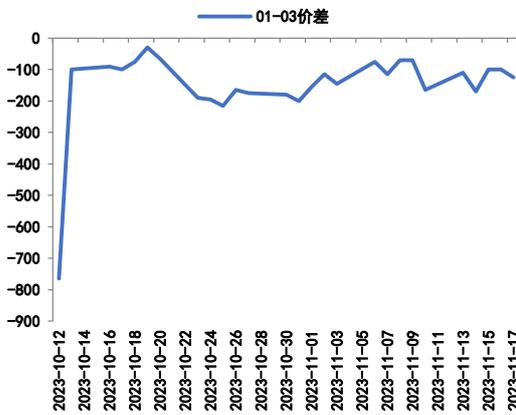
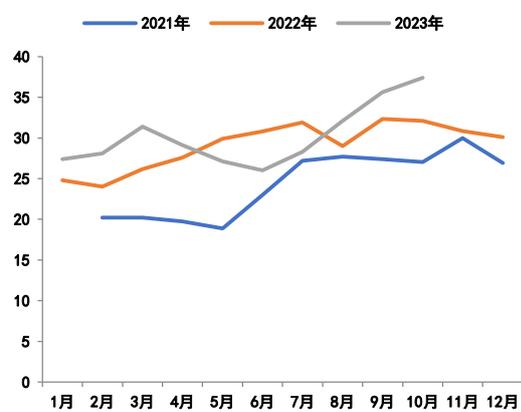


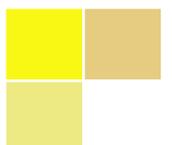
图8：工业硅产量（万吨）



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

2024年1月2星期二，工业硅期货偏强震荡走势，主力合约上涨0.98%至14365元/吨。受多重因素影响，目前西北产区部分硅厂按要求停炉保温。西南地区电价进一步上涨，工厂停工数量增多，整体供应维持偏紧格局。现货价格方面，工业硅现货价格持稳运行。有机硅方面，市场交投气氛有所好转，对后市存看涨情绪，加之原料价格稳步上行，信心增加。多晶硅方面，多晶硅价格企稳，供给过剩格局依旧明显，需求端低迷难改。铝合金方面，铝合金价格小幅上涨，供应量保持地位，市场看涨信心较足，对于工业硅需求保持稳定。总体来看，当



前受供应端缩减及成本端支撑的影响，短期格局有所改善，但由于需求端弱勢难改，长期来看上方依然存压。

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。