

工业硅日报：期价区间震荡 供应端持续上升

2024 年 7 月 2 日星期二

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	SI2409 (主力)	收盘价	2024/7/2	元/吨	11455	11465	10	0.09%
		成交量	2024/7/2	手	147353	179731	32378	21.97%
		持仓量	2024/7/2	手	223782	227134	3352	1.50%
	SI2410价格		2024/7/2	元/吨	11525	11545	20	0.17%
现货	不通氧5530 (华东)		2024/7/2	元/吨	12350	12350	0	0.00%
	通氧5530 (华东)		2024/7/2	元/吨	12750	12750	0	0.00%
	4210 (华东)		2024/7/2	元/吨	13550	13550	0	0.00%
价差	SI2409基差		2024/7/2	元/吨	895	885	-10	-1.12%
	SI2410基差		2024/7/2	元/吨	825	805	-20	-2.42%
	09-10价差		2024/7/2	元/吨	-70	-80	-10	14.29%

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 华东部分硅价小幅走跌，SMM 华东不通氧 553#在 12300-12400 元/吨，通氧 553#在 12600-12800 元/吨，521#在 12900-13100 元/吨，441#在 13000-13200 元/吨，均价下调 100 元/吨；421#在 13500~13600 元/吨；421#有机硅用在 13800-13900 元/吨；3303#在 13600-13900 元/吨，均价下调 100 元/吨。昆明、黄埔港、天津港、四川、上海地区部分硅价小幅走跌，新疆、福建地区硅价持稳。再生硅今日价格也有走跌。

2、2023 年我国光伏设备产业规模同比增长近 70% 各主要环节设备基本完成国产化。展望 2024，光伏设备产业的发展将呈现以下特点。光伏制造企业持续的产能扩张及改造给光伏设备公司带来新的市场空间，扩产逻辑包括 N 型硅片、高效电池产能的落地；电池现有产能向 TOPCon 产能的升级；大尺寸产能的升级以及其他技术升级的需要。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价走势

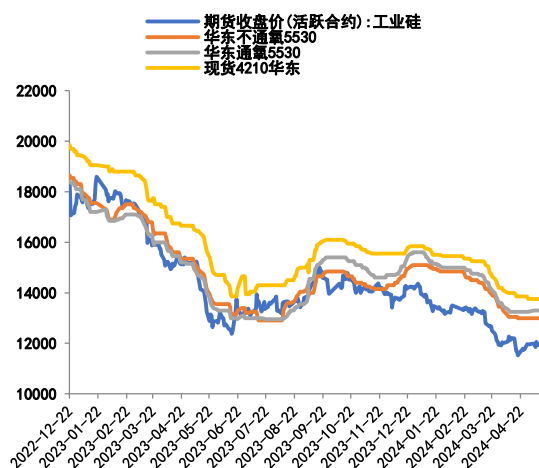


图2：工业硅期货成交量及持仓量

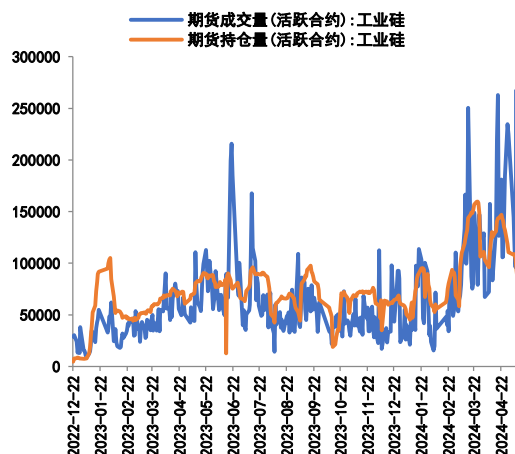


图3：工业硅不通氧5530基差

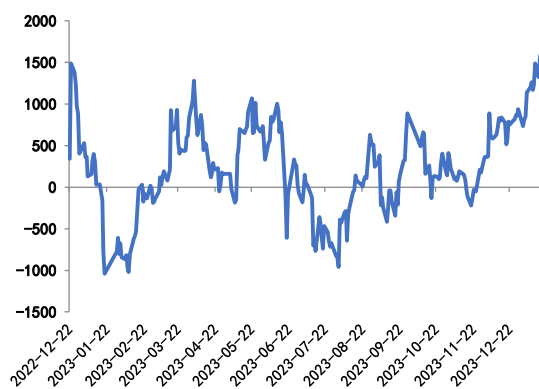


图4：工业硅通氧5530基差

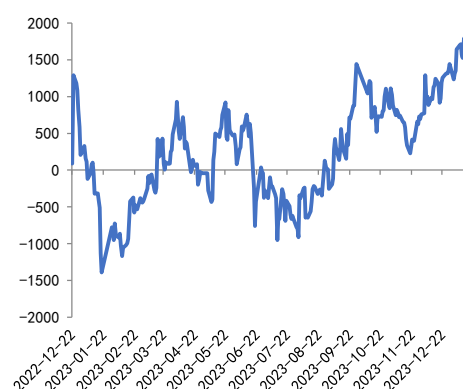


图5：工业硅4210基差

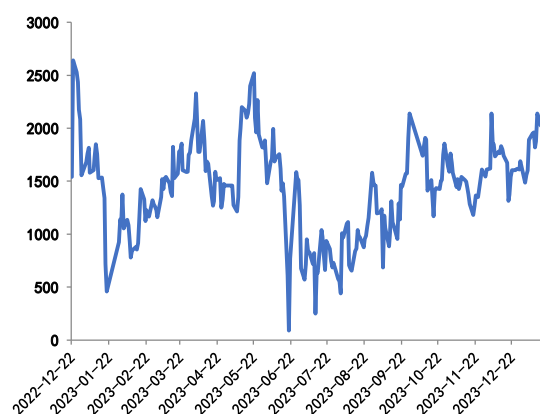
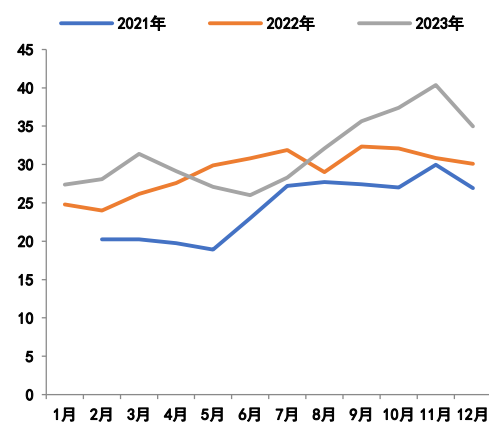


图6：工业硅产量（万吨）



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7月2日星期二，工业硅期货主力合约区间震荡，收涨0.39%至11465元/吨。当前工业硅基本面持续偏弱，呈供强需弱态势。供应端西南产区持续复

产，整体开工率上行，供应持续上涨。西北产区维持高开工率，全国产量增加。下游需求端无明显起色，去库压力较大。现货价格方面，工业硅现货价格部分下跌。有机硅成本支撑减弱，下游需求疲弱，市场观望情绪浓厚。多晶硅价格企稳，下游需求持续疲软，市场情绪一般。铝合金价格企稳，下游刚需采购为主，企业生产意愿不高，市场观望情绪浓厚。总体来看，当前工业硅基本面偏弱运行，随着产量上行，下游需求端未见好转迹象，预计工业硅期货价格偏弱震荡为主。

朱皓天 期货从业资格号：F3056907；投资咨询证书号：Z0016204

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

免责条款：

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。