

工业硅日报：需求恢复不及预期 工业硅持续探底

2023年3月15日 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	昨日	今日	涨跌量	涨跌幅
期货	SI08 (主力)	收盘价	3/15	元/吨	16905	16740	-165	-0.98%
		成交量	3/15	手	27612	28714	1102	3.99%
		持仓量	3/15	手	51114	51155	41	0.08%
	SI09价格		3/15	元/吨	16800	16660	-140	-0.83%
	SI10价格		3/15	元/吨	16785	16645	-140	-0.83%
现货	通氧5530 (华东)		3/15	元/吨	17050	16950	-100	-0.59%
	不通氧5530 (华东)		3/15	元/吨	16600	16500	-100	-0.60%
	4210 (华东)		3/15	元/吨	18300	18100	-200	-1.09%
价差	基差	SI08基差	3/15	元/吨	145	210	65	44.83%
		SI09基差	3/15	元/吨	250	290	40	16.00%
		SI10基差	3/15	元/吨	265	305	40	15.09%
	跨期	8-9价差	3/15	元/吨	105	80	-25	-23.81%
		8-10价差	3/15	元/吨	120	95	-25	-20.83%

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、国家统计局：1-2月全国房地产开发投资下降5.7%。国家统计局数据3月15日公布了1-2月全国房地产开发投资数据。1—2月份，全国房地产开发投资13669亿元，同比下降5.7%；其中，住宅投资10273亿元，下降4.6%。1—2月份，房地产开发企业房屋施工面积750240万平方米，同比下降4.4%。其中，住宅施工面积527695万平方米，下降4.7%。房屋新开工面积13567万平方米，下降9.4%。

2、国家统计局：1-2月全国规上工业增加值同比增长2.4% 环比回升。1—2月份，规模以上工业增加值同比实际增长2.4%。从环比看，2月份，规模以上工业增加值比上月增长0.12%。分三大门类看，1—2月份，采矿业增加值同比增长4.7%，制造业增长2.1%，电力、热力、燃气及水生产和供应业增长2.4%。

3、美国2月CPI同环比均回落 核心CPI同比连续五个月下滑。美国2月

CPI 环比上升 0.4%，为 2022 年 12 月以来新低，预估为 0.4%，前值为 0.5%。美国 2 月 CPI 同比上升 6.0%，这也是美国 CPI 同比涨幅自 2022 年 6 月创出 40 年来峰值 9.1%后连续 8 个月下降，为 2021 年 9 月以来新低。美国 2 月未季调核心 CPI 同比上升 5.5%，已连续第五个月下降，为 2021 年 12 月来新低，预期 5.50%，前值 5.60%。美国 2 月 CPI 数据公布后，美股三大指数期货快速拉升，均涨超 1%。美元指数小幅震荡，截至 20:49 分，几近持平。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

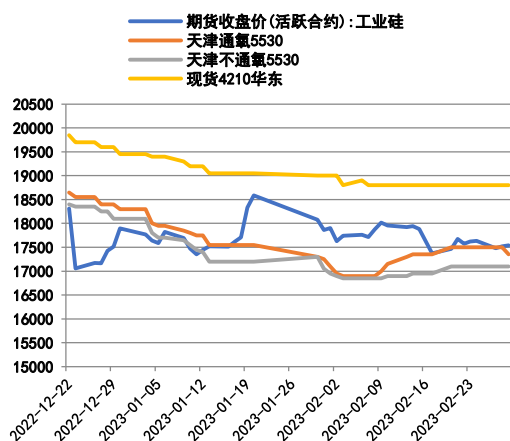


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

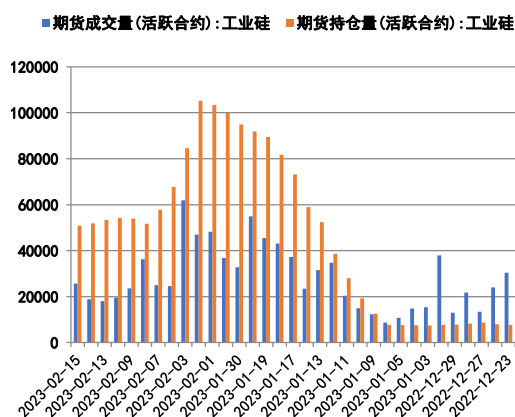


图3：基差（S08）

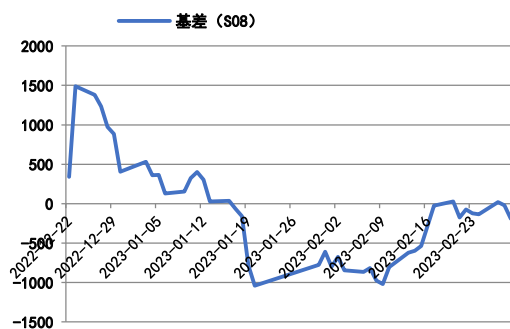


图4：基差（S09）

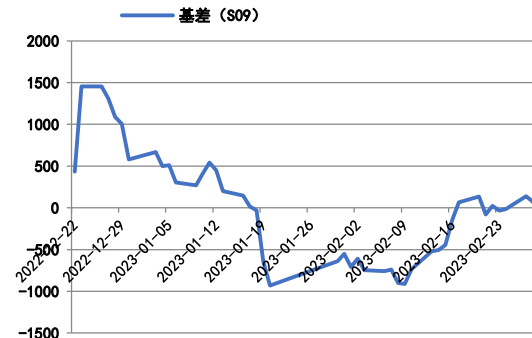


图5: 基差 (SI0)

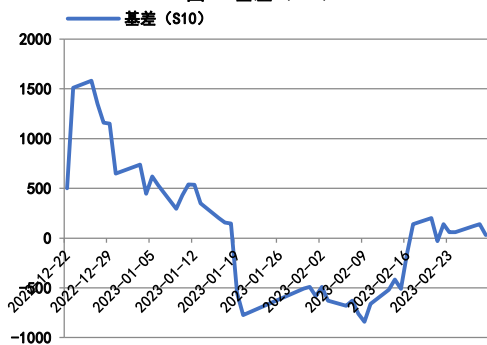


图6: 8-9价差

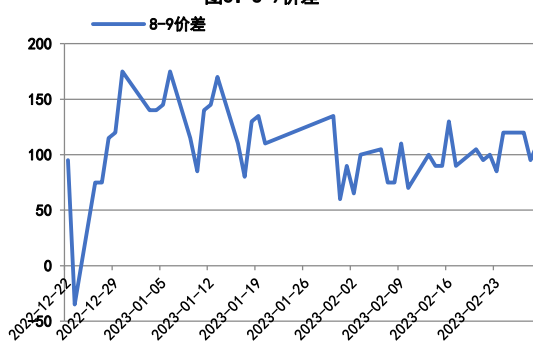


图7: 8-10价差

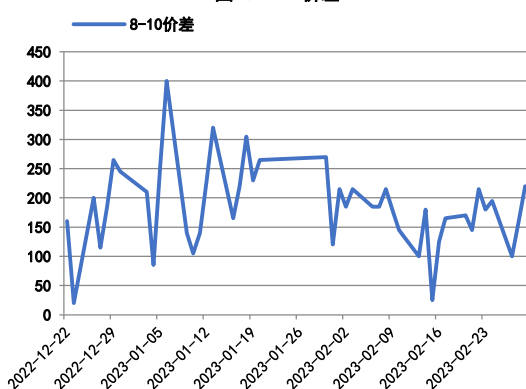
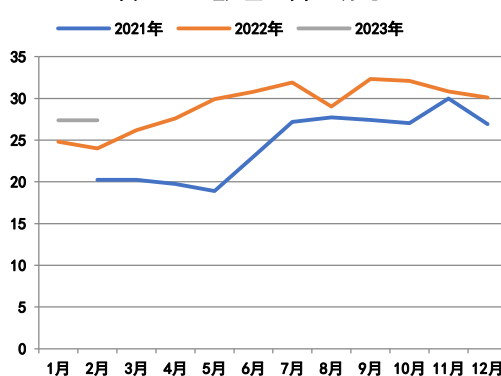


图8: 工业硅产量 (单位: 万吨)



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3月15日星期三,工业硅期货继续探底,主力合约SI2308收跌1.24%,最终收盘价为16740元/吨。现货方面,工业硅现货价格继续回落,社会库存小幅累库,工业硅现货加格跌幅扩大。供应方面,北方开工率高位,供应充足,南方枯水季,产量维持低位。需求方面,有机硅消化库存为主,整体来看供需博弈呈弱势僵持运行。多晶硅价格下跌明显,当前硅料库存量较高叠加下游市场需求较弱,多晶硅厂家开工率下调。铝合金价格持稳,市场观望情绪浓厚,下游维持刚需采购。



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。