

工业硅日报：期价偏弱震荡 产量预计增涨

2023 年 7 月 6 星期四

一、每日数据监测

			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	SI09 (主力)	收盘价	2023/7/6	元/吨	13100	13215	115	0.88%
		成交量	2023/7/6	手	38213	35456	-2757	-7.21%
		持仓量	2023/7/6	手	63317	68603	5286	8.35%
	SI08价格		2023/7/6	元/吨	13120	13190	70	0.53%
	SI10价格		2023/7/6	元/吨	13145	13245	100	0.76%
现货	通氧5530 (华东)		2023/7/6	元/吨	13250	13250	0	0.00%
	不通氧5530 (华东)		2023/7/6	元/吨	13000	13000	0	0.00%
	4210 (华东)		2023/7/6	元/吨	14050	14050	0	0.00%
价差	基差	SI08基差	2023/7/6	元/吨	150	35	-115	-76.67%
		SI09基差	2023/7/6	元/吨	130	60	-70	-53.85%
		SI10基差	2023/7/6	元/吨	105	5	-100	-95.24%
	跨期	8-9价差	2023/7/6	元/吨	-20	25	45	-225.00%
		9-10价差	2023/7/6	元/吨	-45	-30	15	-33.33%

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。7 月 6 日，SMM 华东不通氧 553#在 12900~13100 元/吨。通氧 553#在 13100~13400 元/吨。521#在 13600~13800 元/吨。441#在 13600~13800 元/吨。421#在 13800~14300 元/吨。421#有机硅用在 14500~14800 元/吨。3303#在 14200~14400 元/吨。天津港、黄埔港、新疆、四川、昆明、福建地区工业硅价格暂稳，97 硅和金属硅粉价格也持稳。

2、第三代半导体领域现 20 亿美金大单 产品在汽车和新能源中应用急剧增加。①瑞萨向 Wolfspeed 支付了 20 亿美元的定金，以确保 6 英寸/8 英寸 SiC 晶圆的供应，并支持 Wolfspeed 的美国产能扩张计划。②2027 年全球导电型碳化硅功率器件市场空间有望突破至 62.97 亿美元。

3、乘联会：初步统计 6 月乘用车市场零售 189.6 万辆，环比增长 9%，乘联会初步统计，6 月 1-30 日，乘用车市场零售 189.6 万辆，同比下降 2%，环比增

长 9%；今年以来累计零售 952.8 万辆，同比增长 3%；全国乘用车厂商批发 223.0 万辆，同比增长 2%，环比增长 11%；今年以来累计批发 1,106.2 万辆，同比增长 9%。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

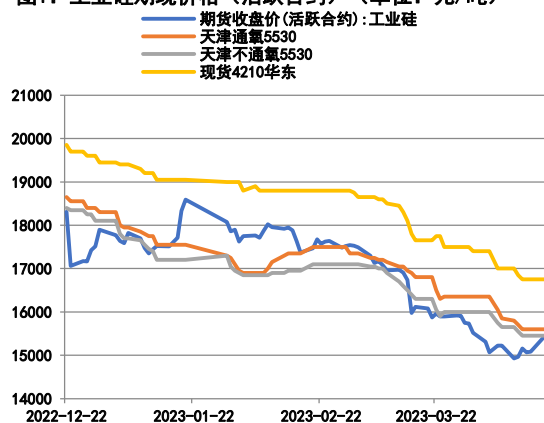


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

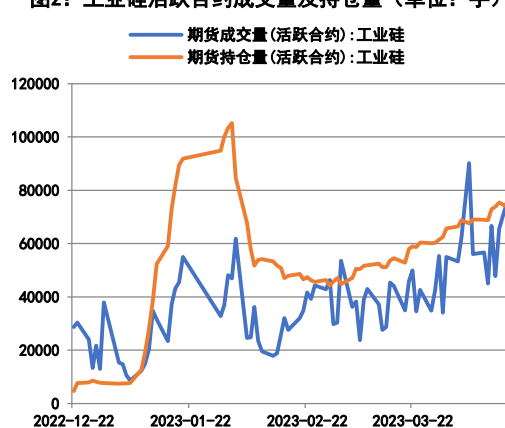


图3：基差（S08）

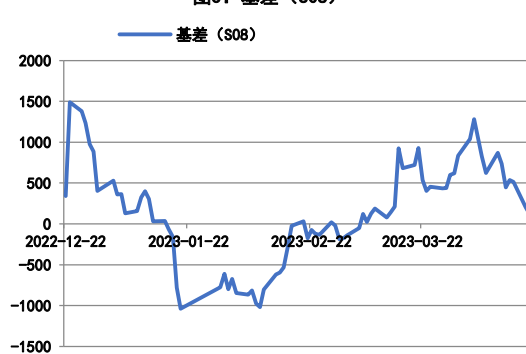


图4：基差（S09）

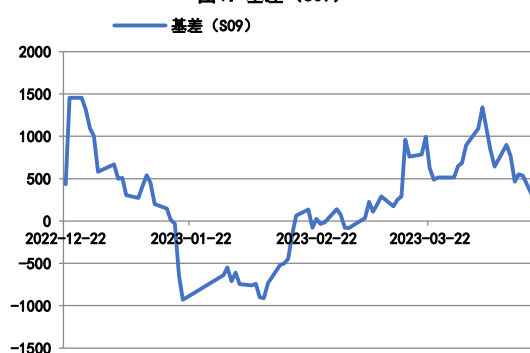


图5：基差（S10）



图6：8-9价差

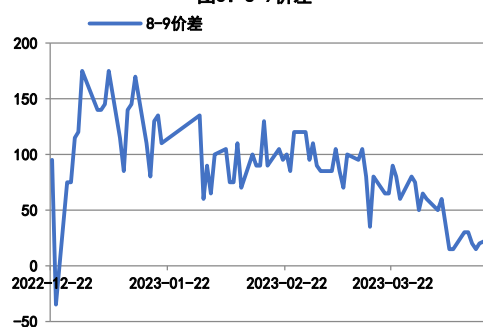


图7：8-10价差

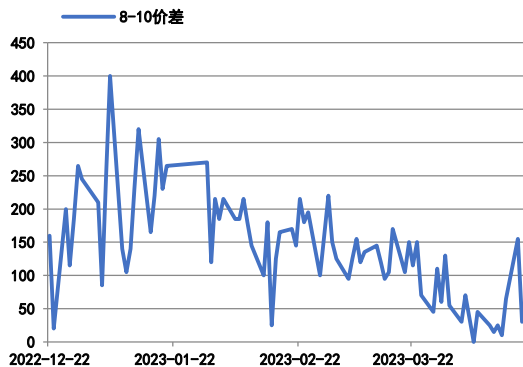
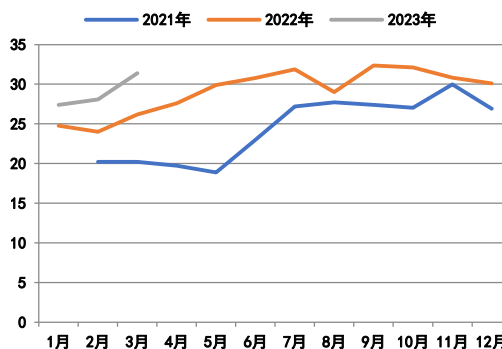


图8：工业硅产量（单位：万吨）



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 7 月 6 星期四,工业硅期货偏弱震荡,新晋主力合约 2309 收涨 0.11% 至 13215 元/吨。现货方面,工业硅现货报价保持稳定。供应端,云南地区硅厂开工率攀升,但不及去年同期,北方零星硅厂计划开炉,预计近期硅产量将显著提升。需求方面,有机硅价格偏弱运行,市场交投氛围冷清。终端需求难以提振,市场僵持难改。多晶硅现货价格节后下跌明显,市场供给充足,库存不断累积,下游看跌情绪浓厚。铝合金价格支撑不足,市场整体观望情绪浓厚,下游按需采购,实际成交表现一般。总的来看,当前工业硅基本面依然偏弱,供应上升,下游需求不及预期持续低迷,库存累库现象较为严重,盘面整体承压。

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。