

工业硅日报：工业硅偏弱震荡 基本面无明显改善

2023 年 8 月 1 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	昨日	今日	涨跌量	涨跌幅
期货	SI09 (主力)	收盘价	2023/8/1	元/吨	13725	13745	20	0.15%
		成交量	2023/8/1	手	69625	37806	-31819	-45.70%
		持仓量	2023/8/1	手	86823	81563	-5260	-6.06%
	SI08价格		2023/8/1	元/吨	13650	13680	30	0.22%
	SI10价格		2023/8/1	元/吨	13785	13805	20	0.15%
现货	通氧5530 (华东)		2023/8/1	元/吨	12900	12900	0	0.00%
	不通氧5530 (华东)		2023/8/1	元/吨	12950	12950	0	0.00%
	4210 (华东)		2023/8/1	元/吨	14300	14300	0	0.00%
价差	基差	SI08基差	2023/8/1	元/吨	-825	-845	-20	2.42%
		SI09基差	2023/8/1	元/吨	-750	-780	-30	4.00%
		SI10基差	2023/8/1	元/吨	-885	-905	-20	2.26%
	跨期	8-9价差	2023/8/1	元/吨	75	65	-10	-13.33%
		9-10价差	2023/8/1	元/吨	-60	-60	0	0.00%

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 分析：单体企业开工迅速提升产量创近年新高 7 月 DMC 产量环比大涨 27.24%，7 月我国有机硅产量为 19.71 万吨，环比增长 27.24%。7 月整月行业开工率为 86.90%，较 6 月提升 17.90 个百分点。7 月产量增长原因主要由于前期单体企业复工复产较多，开工率集中提升导致 DMC 产量增长明显。

2、SMM 华东工业硅价格持稳。8 月 1 日，SMM 华东不通氧 553#在 12900~13000 元/吨。通氧 553#在 12600~13200 元/吨。521#在 13500~13700 元/吨。441#在 13000~13700 元/吨。421#在 14000~14600 元/吨。421#有机硅用在 14500~15000 元/吨。3303#在 14400~14600 元/吨。天津港、黄埔港、四川、福建、新疆地区硅价都持稳运行，昆明 3303#硅价小幅上调 50 元/吨。97 硅和金属硅粉价格也持稳。

3、国家能源局：上半年全国光伏发电量 2663 亿千瓦时 同比增 30%。7 月 31 日，国家能源局召开三季度例行新闻发布会，发布 2023 年上半年能源形势、可再生能源发展情况。提及光伏发电建设和运行情况，新能源和可再生能源司副司长王大鹏表示，上半年，全国光伏新增并网 7842 万千瓦，同比增长 154%，其中集中式光伏发电 3746 万千瓦，同比增长 234%，分布式光伏发电 4096 万千瓦，同比增长 108%。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

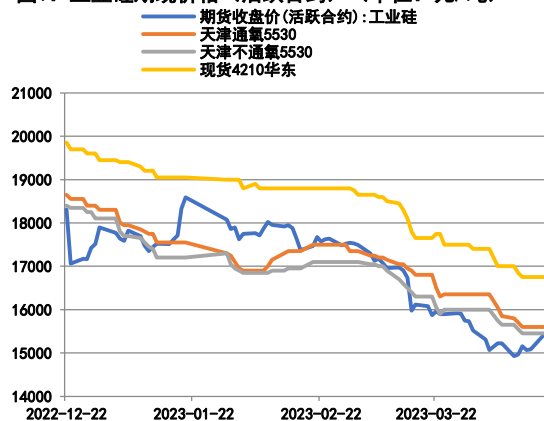


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

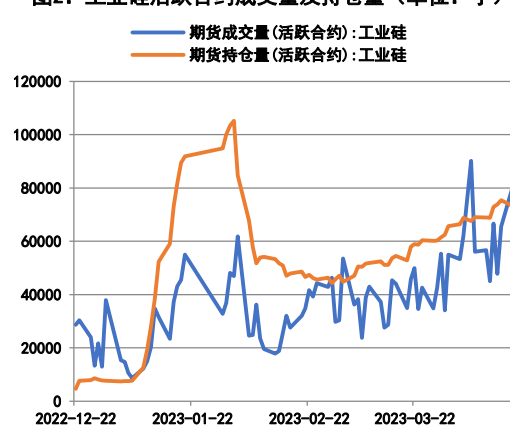


图3：基差（S08）

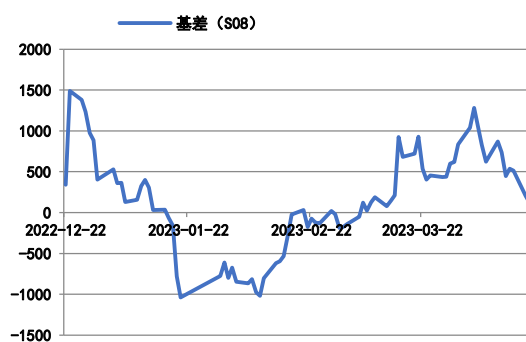
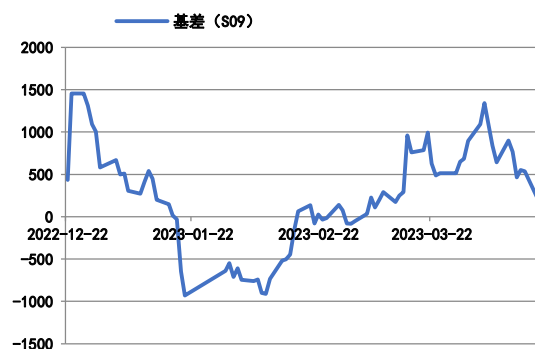
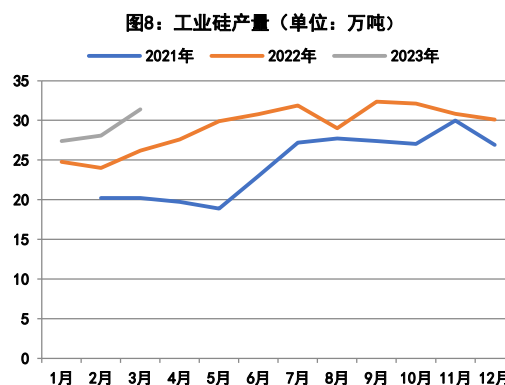
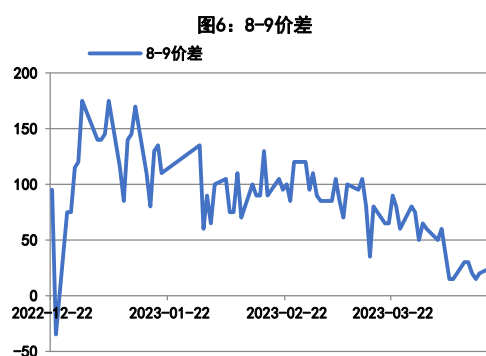
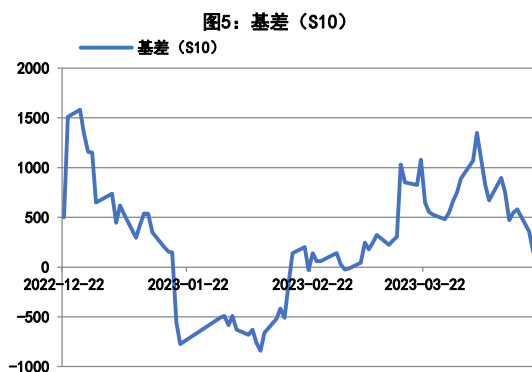


图4：基差（S09）





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 8 月 1 星期二, 工业硅期货偏弱震荡, 主力合约 2309 下跌 0.33%至 13745 元/吨。现货方面, 工业硅现货报价持稳运行。供应端整体社会供应量保持平稳, 四川大运会短期看来对工业硅产量影响有限。云南区域基本完全复产, 足以弥补四川地区减产空缺。需求方面, 有机硅价格持稳, 市场交投氛围冷清, 市场僵持难改。多晶硅现货价格企稳, 硅料产能提升明显, 下游市场需求旺盛。铝合金价格小幅上涨, 受宏观政策提振, 市场情绪有所好转。总的来看, 当前工业硅基本面未出现明显改善, 去库压力仍存, 下游需求无明显改善, 预计未来仍呈现震荡格局。



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。