

## 工业硅日报：工业硅震荡收涨 需求无明显改善

2023 年 8 月 2 星期二

### 一、每日数据监测

| 金石期货<br>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<br>(主力) | 收盘价    | 2023/8/2    | 元/吨 | 13745 | 13860 | 115   | 0.84%  |
|                        |              | 成交量    | 2023/8/2    | 手   | 37806 | 59219 | 21413 | 56.64% |
|                        |              | 持仓量    | 2023/8/2    | 手   | 81563 | 75167 | -6396 | -7.84% |
|                        | SI08价格       |        | 2023/8/2    | 元/吨 | 13680 | 13800 | 120   | 0.88%  |
|                        | SI10价格       |        | 2023/8/2    | 元/吨 | 13805 | 13945 | 140   | 1.01%  |
| 现货                     | 通氧5530 (华东)  |        | 2023/8/2    | 元/吨 | 12900 | 12900 | 0     | 0.00%  |
|                        | 不通氧5530 (华东) |        | 2023/8/2    | 元/吨 | 12950 | 12950 | 0     | 0.00%  |
|                        | 4210 (华东)    |        | 2023/8/2    | 元/吨 | 14300 | 14300 | 0     | 0.00%  |
| 价差                     | 基差           | SI08基差 | 2023/8/2    | 元/吨 | -845  | -960  | -115  | 13.61% |
|                        |              | SI09基差 | 2023/8/2    | 元/吨 | -780  | -900  | -120  | 15.38% |
|                        |              | SI10基差 | 2023/8/2    | 元/吨 | -905  | -1045 | -140  | 15.47% |
|                        | 跨期           | 8-9价差  | 2023/8/2    | 元/吨 | 65    | 60    | -5    | -7.69% |
|                        |              | 9-10价差 | 2023/8/2    | 元/吨 | -60   | -85   | -25   | 41.67% |

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、据 SMM 调研，近期由于有机硅单体企业装置检修计划增多，国内有机硅单体开工率将有所下调。山东单体企业一期、二期装置今日已停车；内蒙单体企业也近期计划停车检修，检修时长 15-20 天；云南单体企业目前已停车一条，9 号计划再度停车另外一条；浙江单体企业开车计划推迟，具体开车时间未定。

2、SMM 华东工业硅价格持稳。8 月 2 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，昆明地区 421#和 3303#硅价小幅上涨。97 硅价格持稳。

3、2023 年上半年全球光伏装机势头强劲，中国作为光伏装机最大增量市场，2023 年 1-6 月光伏新增装机 78.4GW，创历史新高，其他区域市场光伏装机需求持续火热。集邦咨询旗下新能源研究中心 EnergyTrend 将聚焦于亚太、欧洲、美洲三大区域，分析各重点国家月度光伏装机需求情况。

### 三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

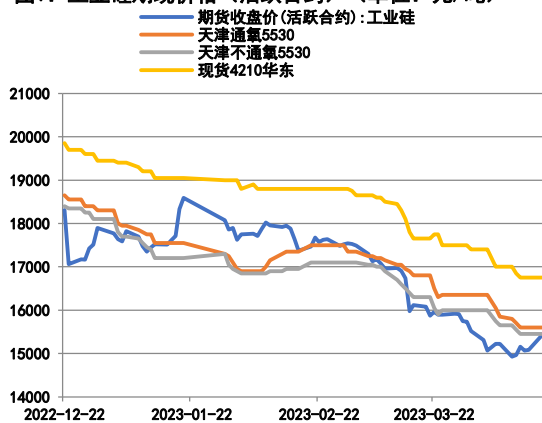


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

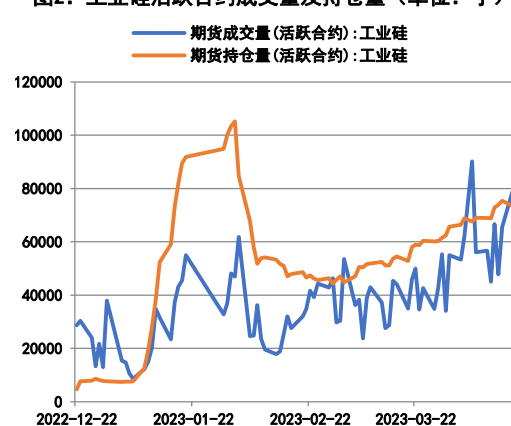


图3：基差（S08）

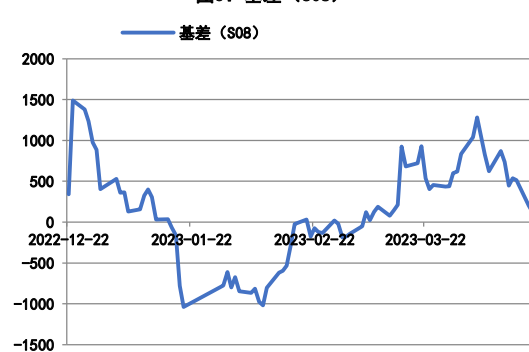


图4：基差（S09）

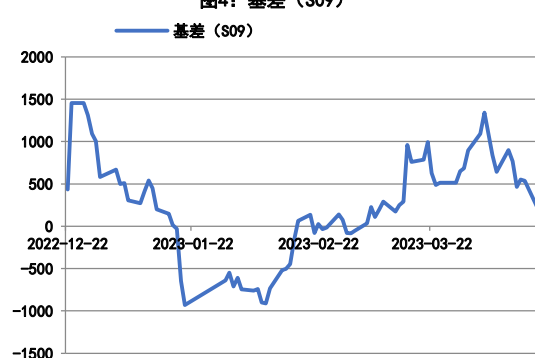


图5：基差（S10）

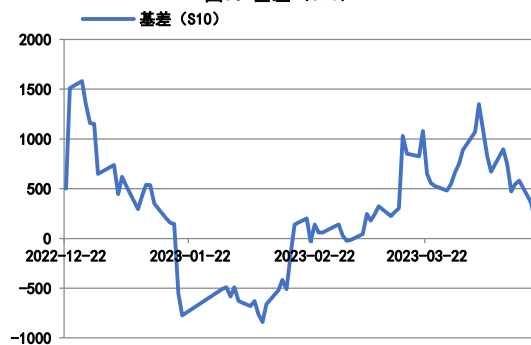


图6：8-9价差

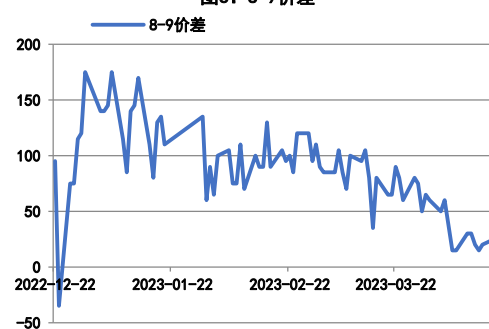


图7：8-10价差

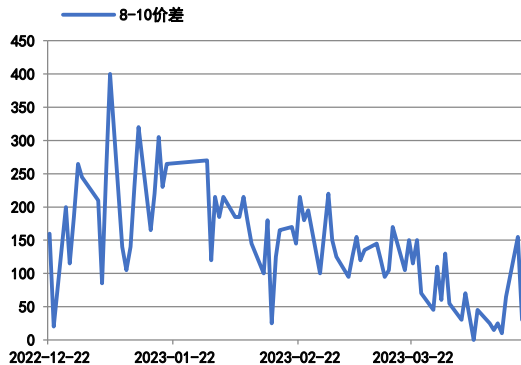
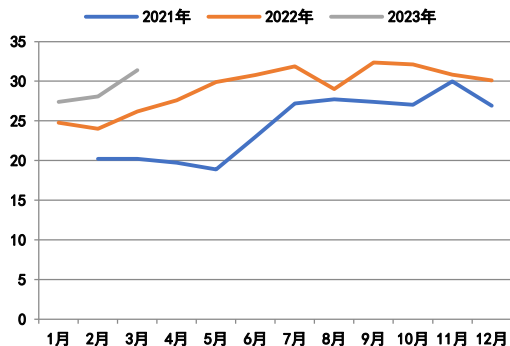


图8：工业硅产量（单位：万吨）



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 8 月 2 星期三，工业硅期货震荡上涨，主力合约 2309 上涨 0.95%至 13860 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。

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。