

工业硅日报：工业硅期货大幅下挫 基本面供需格局不变

2023 年 8 月 3 星期四

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	2023/8/3	元/吨	13860	13290	-570	-4.11%
		成交量	2023/8/3	手	59219	71156	11937	20.16%
		持仓量	2023/8/3	手	75167	58273	-16894	-22.48%
	SI08价格		2023/8/3	元/吨	13800	13205	-595	-4.31%
	SI10价格		2023/8/3	元/吨	13945	13365	-580	-4.16%
现货	通氧5530 (华东)		2023/8/3	元/吨	12900	12900	0	0.00%
	不通氧5530 (华东)		2023/8/3	元/吨	12950	12950	0	0.00%
	4210 (华东)		2023/8/3	元/吨	14300	14300	0	0.00%
价差	基差	SI08基差	2023/8/3	元/吨	-960	-390	570	-59.38%
		SI09基差	2023/8/3	元/吨	-900	-305	595	-66.11%
		SI10基差	2023/8/3	元/吨	-1045	-465	580	-55.50%
	跨期	8-9价差	2023/8/3	元/吨	60	85	25	41.67%
		9-10价差	2023/8/3	元/吨	-85	-75	10	-11.76%

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、工信部：上半年光伏压延玻璃产量同比增 68.7% 均价同比下滑，2023 年 1-6 月，，光伏压延玻璃累计产量 1156.5 万吨，同比增加 68.7%，其中 5 月产量 203.4 万吨，同比增加 48.2%。价格方面，1-6 月，2 毫米、3.2 毫米光伏压延玻璃平均价格为 18.5 元 / 平方米、25.6 元 / 平方米，同比下降 11.7%、5.4%。

2、SMM 华东工业硅价格持稳。8 月 3 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。昆明、天津港、黄埔港、四川、福建、新疆地区硅价都持稳运行。97 硅和金属硅粉价格也持稳。

3、新疆无粘结硅煤月末再调价 7 月价格持续走跌。疆内保利无粘结硅煤有较长一段时间价居高位，进入 6 月下旬，随着疆内头部大厂减产发生，疆内无粘结硅煤出货渐显不畅，7 月开始大幅调价走低，7 月月内价格更是连续走低。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

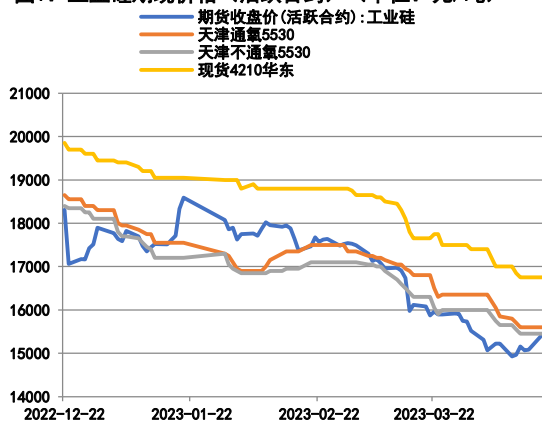


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

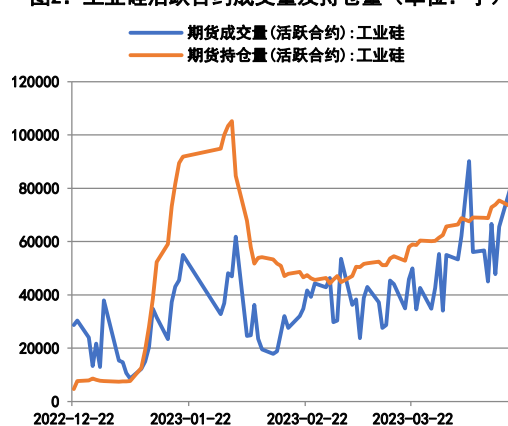


图3：基差（S08）

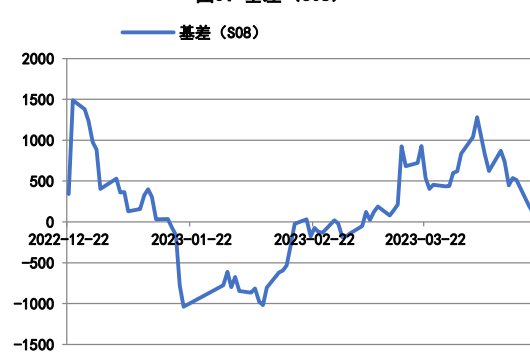


图4：基差（S09）

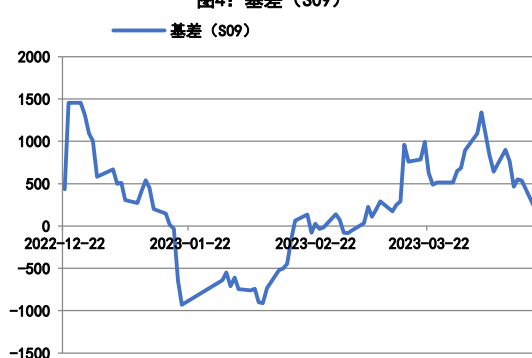


图5：基差（S10）



图6：8-9价差

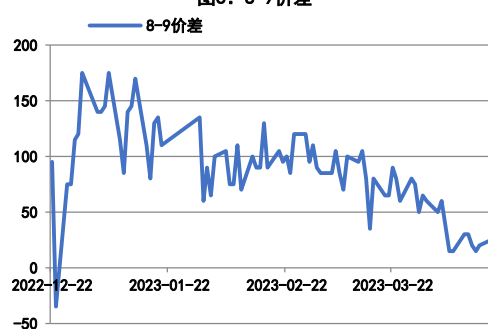


图7：8-10价差

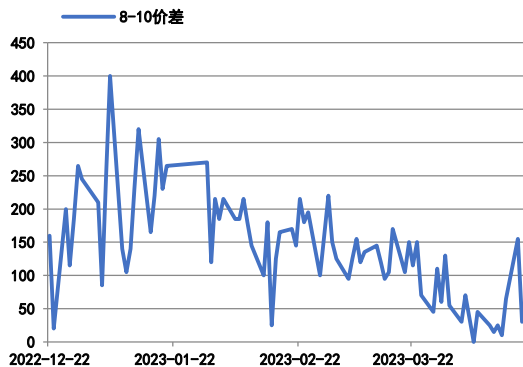
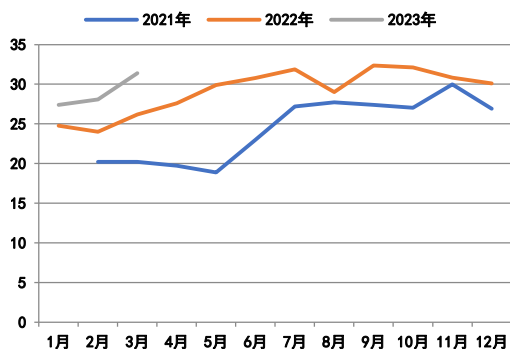


图8：工业硅产量（单位：万吨）



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 3 星期四，工业硅期货跟随商品整体跌势大幅下挫，主力合约 2309 下跌 3.87%至 13290 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。