

工业硅日报：市场情绪有所转暖 需求端出现改善

2023 年 9 月 5 日 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	SI10 (主力)	收盘价	2023/9/5	元/吨	13845	13915	70	0.51%
		成交量	2023/9/5	手	109120	41090	-68030	-62.34%
		持仓量	2023/9/5	手	52666	48493	-4173	-7.92%
	SI11价格		2023/9/5	元/吨	13935	13990	55	0.39%
	SI12价格		2023/9/5	元/吨	14385	14415	30	0.21%
现货	通氧5530 (华东)		2023/9/5	元/吨	14150	14300	150	1.06%
	不通氧5530 (华东)		2023/9/5	元/吨	13650	13800	150	1.10%
	4210 (华东)		2023/9/5	元/吨	15050	15150	100	0.66%
价差	基差	SI11基差	2023/9/5	元/吨	215	310	95	44.19%
		SI12基差	2023/9/5	元/吨	-235	-115	120	-51.06%
		SI10基差	2023/9/5	元/吨	305	385	80	26.23%
	跨期	10-11价差	2023/9/5	元/吨	-90	-75	15	-16.67%
		10-12价差	2023/9/5	元/吨	-540	-500	40	-7.41%

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、合盛硅业工业硅报价上调 300 元/吨。根据 SMM 最新消息，9 月 5 日合盛官网硅云工业硅报价上调 300 元/吨，华东地区通氧 553#硅报价 14300 元/吨，551#报价 14400 元/吨，441#硅报价 14600 元/吨，421#硅报价 14800 元/吨。

2、有机硅巨头埃肯进行产能升级，在上海工厂开辟新的有机硅高端电子胶生产线，已于 2023 年 7 月底投入生产，目前运行状况良好。新产线增加约 1500 吨/年产能，主要生产高端导热系列产品。其中包括导热灌封、填缝、粘接等产品。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

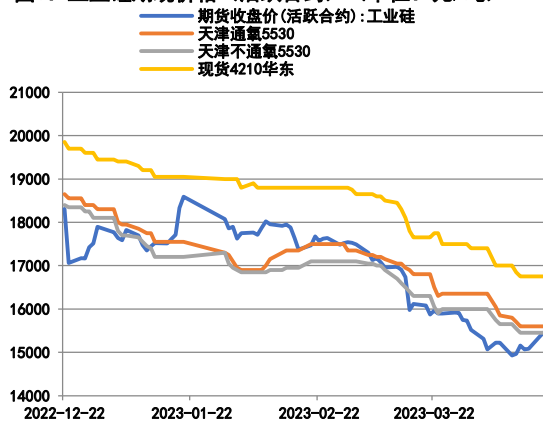


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

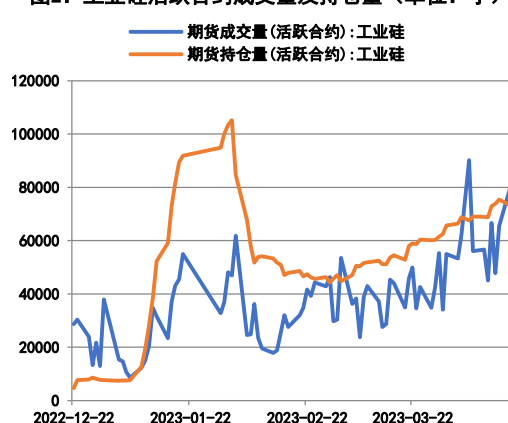


图3：基差（S10）

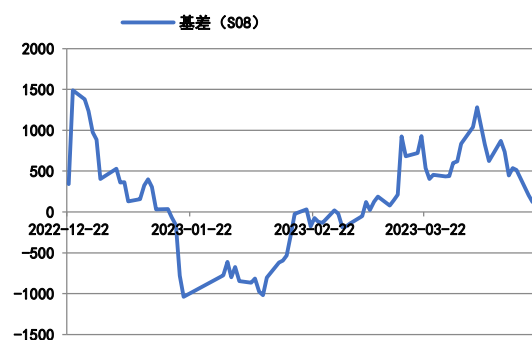


图4：基差（S11）

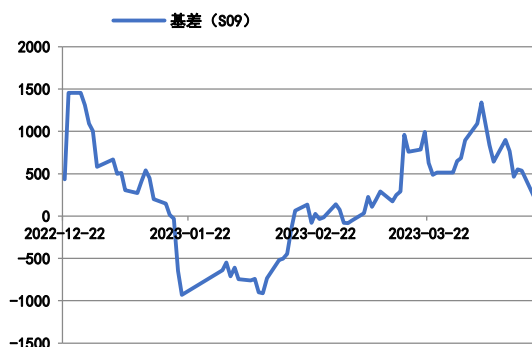


图5：基差（S12）



图6：10-11价差

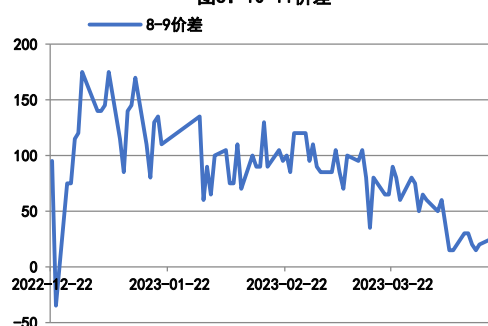


图7：10-12价差

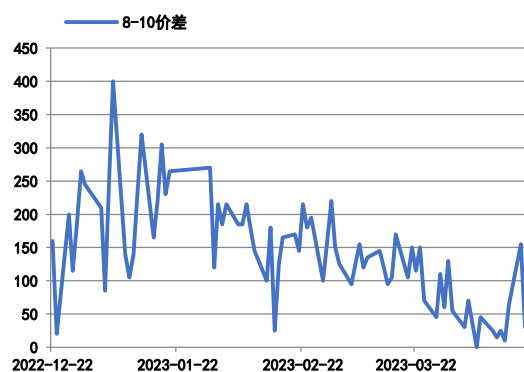
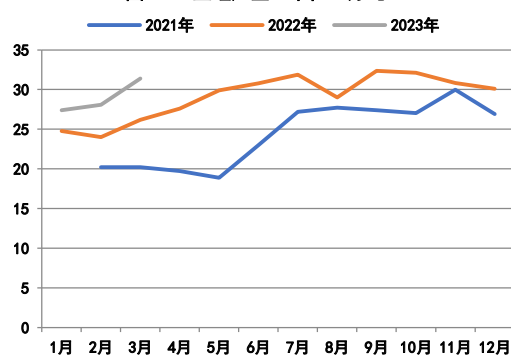


图8：工业硅产量（单位：万吨）



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9月5星期二，工业硅期货主力移仓明显，当前主力合约2310震荡收跌1.28%至13915元/吨。现货方面，工业硅现货报价持续上涨。供应端目前工业硅主产区供应呈上涨趋势，西北地区产能稳定释放。西南地区开工平稳，供应扰动因素逐渐消除。需求方面，有机硅价格保持稳定，当前市场刚需为主，市场氛围较冷清。多晶硅现货价格保持稳定，下游市场需求旺盛，订单处于历史高峰，库存维持低位，对于工业硅需求预计存在支撑。铝合金价格平稳运行，市场刚需采购为主，观望情绪浓厚，无明显起色。总的来看，当前，宏观利好及需求改善支撑工业硅盘面情绪有所转暖，但当前宏观不确定因素仍存，建议保持观望。

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