

工业硅日报：工业硅偏强震荡 市场信心逐步增强

2023 年 9 月 8 日 星期五

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	SI11 (主力)	收盘价	2023/9/8	元/吨	14125	14240	115	0.81%
		成交量	2023/9/8	手	58410	86214	27804	47.60%
		持仓量	2023/9/8	手	72271	80587	8316	11.51%
	SI10价格		2023/9/8	元/吨	14125	14165	40	0.28%
	SI12价格		2023/9/8	元/吨	14585	14705	120	0.82%
现货	通氧5530 (华东)		2023/9/8	元/吨	14000	14000	0	0.00%
	不通氧5530 (华东)		2023/9/8	元/吨	14550	14550	0	0.00%
	4210 (华东)		2023/9/8	元/吨	15300	15300	0	0.00%
价差	基差	SI11基差	2023/9/8	元/吨	-125	-240	-115	92.00%
		SI12基差	2023/9/8	元/吨	-585	-705	-120	20.51%
		SI10基差	2023/9/8	元/吨	-125	-165	-40	32.00%
	跨期	10-11价差	2023/9/8	元/吨	0	75	75	/
		11-12价差	2023/9/8	元/吨	-460	-465	-5	1.09%

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 统计 8 月中国工业硅产量在 32.09 万吨，环比增加 3.8 万吨增幅 13.5%，同比转负为正增幅在 10.6%。2023 年 1-8 月份累计工业硅产量在 229.9 万吨，同比增幅在 2.6%。

2、新能源业务势头持续强劲 斯达半导体：订单饱满 正积极扩产。尽管半导体行业处在周期波动中，但斯达半导体（603290.SH）今年上半年营收、净利双双大增，成为国产功率器件上市公司中“最靓的仔”之一。在今天举行的 2023 年半年度业绩说明会上，斯达半导体董事长沈华表示，“上半年公司市场占有率进一步上升，目前公司订单饱满，整体产能利用率保持在较高水平，公司正在积极扩产建设以满足新能源汽车、光伏发电、风力发电。

3、SMM 华东工业硅价格持稳。9 月 8 日，SMM 华东不通氧 553#在 13900~14100 元/吨。通氧 553#在 14500~14600 元/吨。521#在 14800~15000

元/吨。441#在 14800~15000 元/吨。421#在 15200~15400 元/吨。421#有机硅用在 15500-15700 元/吨。3303#在 15600-15800 元/吨。昆明、黄埔港、天津港、新疆、四川、福建、上海地区硅价均持稳运行。97 硅和金属硅粉价格也持稳。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

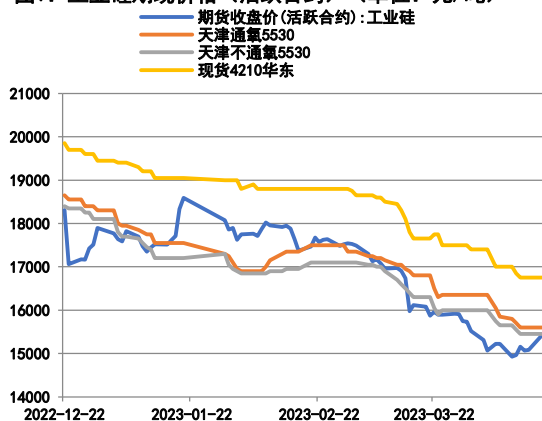


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

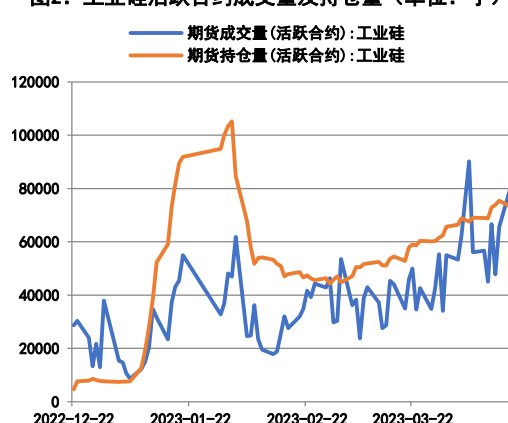


图3：基差（S10）

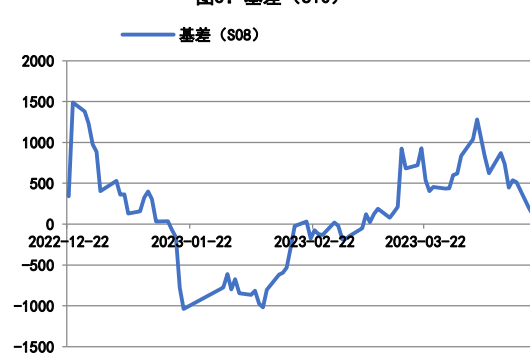


图4：基差（S11）

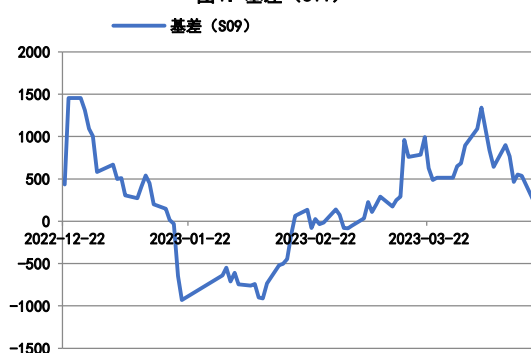


图5：基差（S12）



图6：10-11价差

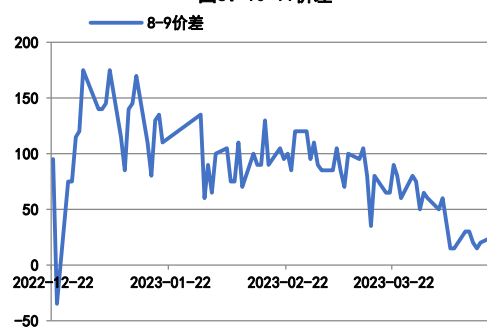


图7：10-12价差

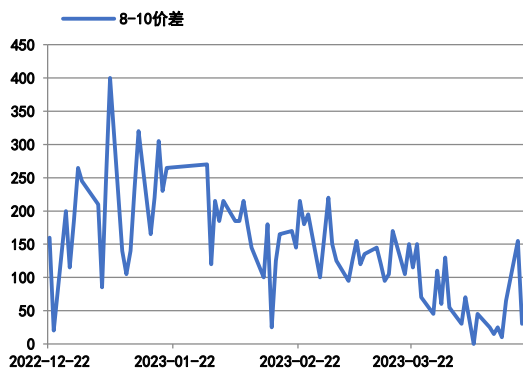
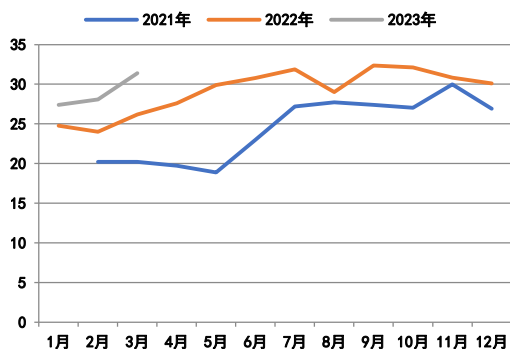


图8：工业硅产量（单位：万吨）



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8日星期五，工业硅期货周五持续震荡，新晋主力合约2311收涨0.49%至14240元/吨。目前工业硅厂家开工处于高位，产量继续冲高但增速放缓，整体产量平稳释放。现货方面，工业硅现货报价逐渐企稳。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，持续关注仓单流向及需求端表现情况。

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。