

工业硅日报：工业硅震荡收涨 基本面无明显改善

2023 年 7 月 26 星期三

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	2023/7/26	元/吨	13555	13615	60	0.44%
		成交量	2023/7/26	手	50181	69165	18984	37.83%
		持仓量	2023/7/26	手	90914	90914	0	0.00%
	SI08价格		2023/7/26	元/吨	13490	13550	60	0.44%
	SI10价格		2023/7/26	元/吨	13590	13655	65	0.48%
现货	通氧5530 (华东)		2023/7/26	元/吨	12900	12900	0	0.00%
	不通氧5530 (华东)		2023/7/26	元/吨	12950	12950	0	0.00%
	4210 (华东)		2023/7/26	元/吨	14300	14300	0	0.00%
价差	基差	SI08基差	2023/7/26	元/吨	-655	-715	-60	9.16%
		SI09基差	2023/7/26	元/吨	-590	-650	-60	10.17%
		SI10基差	2023/7/26	元/吨	-690	-755	-65	9.42%
	跨期	8-9价差	2023/7/26	元/吨	65	65	0	0.00%
		9-10价差	2023/7/26	元/吨	-35	-40	-5	14.29%

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、国家能源局：1—6 月风电光伏新增装机占全国新增装机的 71% 新增发电量占全国新增发电量 54%以上。国家能源局电力司负责人刘明阳表示，2023 年 1—6 月，全国风电、光伏新增装机在 1 亿千瓦以上，累计装机约 8.6 亿千瓦，风电光伏发电量达到 7300 亿千瓦时，风电光伏产业已经成为我国最具竞争力的产业之一。风电光伏发电装机规模不断扩大，已成为我国新增电源装机和新增发电量的双重主体。2023 年 1—6 月，风电光伏新增装机占全国新增装机的比重达到 71%，新增发电量占全国新增发电量 54%以上，有力满足了全国新增电量需求。

2、SMM 华东 3303#硅价小幅上调。月 26 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 14400~14500 元/吨，均价上调 50 元/

吨。天津港、黄埔港、昆明、四川、福建、新疆地区硅价持稳。97 硅和金属硅粉价格也持稳运行。

3、美国半导体协会：劳动力短缺将威胁半导体行业扩张。美国半导体协会(SIA)警告称，美国将没有足够的工程师、计算机科学家和技术人员来支持未来十年半导体行业的快速扩张。该协会的一项调查显示，到 2030 年，半导体制造商将增加约 11.5 万个就业岗位。与此同时，根据一项对当前学位完成率的研究，届时这些就业岗位中约有 58%可能仍会空缺。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

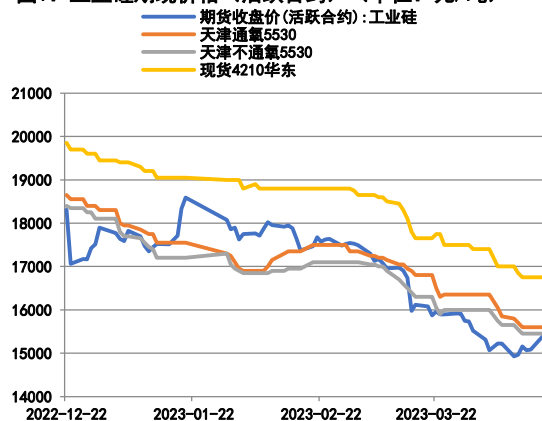


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

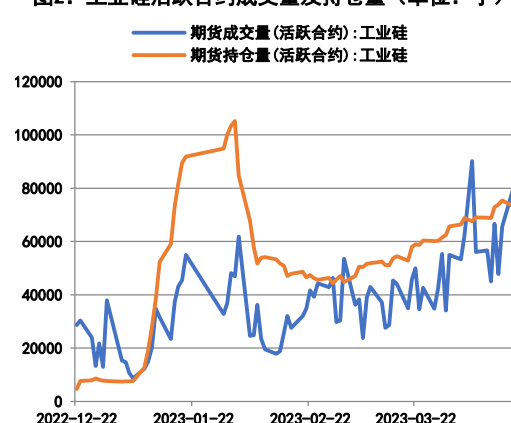


图3：基差（S08）

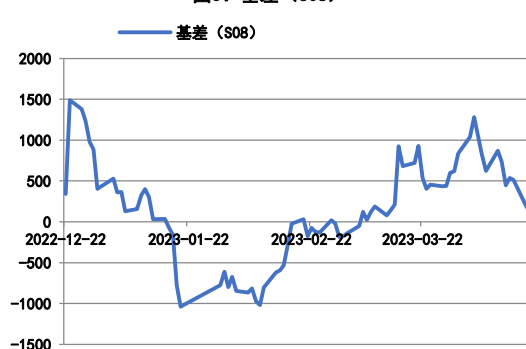
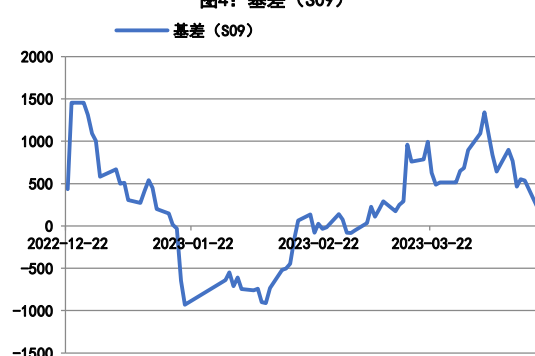
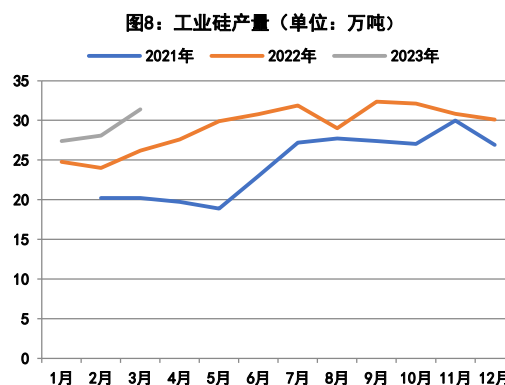
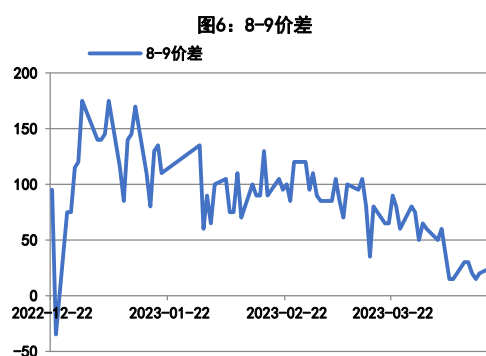
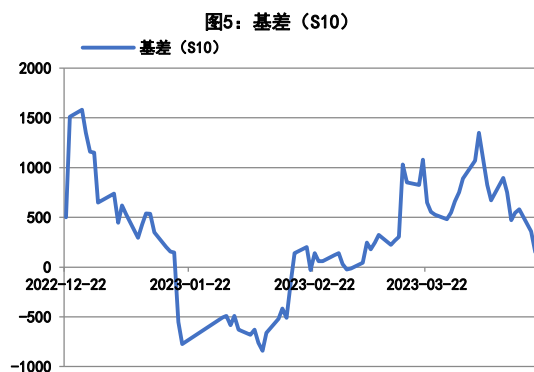


图4：基差（S09）





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 7 月 26 星期三, 工业硅期货窄幅震荡, 主力合约 2309 上涨 0.37% 至 13615 元/吨。现货方面, 工业硅现货报价持稳运行。供应端新疆大厂保温炉陆续恢复生产, 四川地区受大运会影响, 供应略有下降, 云南地区开工处于高位, 大多数厂家都已经复产。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。铝合金价格持稳运行, 下游按需采购, 市场观望情绪浓厚。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。