

工业硅日报：工业硅偏弱震荡 基本面无明显改善

2023 年 7 月 27 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	2023/7/27	元/吨	13615	13570	-45	-0.33%
		成交量	2023/7/27	手	69165	60060	-9105	-13.16%
		持仓量	2023/7/27	手	90914	90237	-677	-0.74%
	SI08价格		2023/7/27	元/吨	13550	13500	-50	-0.37%
	SI10价格		2023/7/27	元/吨	13655	13625	-30	-0.22%
现货	通氧5530 (华东)		2023/7/27	元/吨	12900	12900	0	0.00%
	不通氧5530 (华东)		2023/7/27	元/吨	12950	12950	0	0.00%
	4210 (华东)		2023/7/27	元/吨	14300	14300	0	0.00%
价差	基差	SI08基差	2023/7/27	元/吨	-715	-670	45	-6.29%
		SI09基差	2023/7/27	元/吨	-650	-600	50	-7.69%
		SI10基差	2023/7/27	元/吨	-755	-725	30	-3.97%
	跨期	8-9价差	2023/7/27	元/吨	65	70	5	7.69%
		9-10价差	2023/7/27	元/吨	-40	-55	-15	37.50%

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、有机硅巨头陶氏公布第二季度业绩，陶氏公布 2023 年第二季度业绩。公司董事长兼首席执行官吉姆·菲特林(Jim Fitterling)对该季度发表评论:陶氏团队在第二季度实现了连续盈利改善，并产生了超过 13 亿美元的运营现金流。我们通过实施有针对性的成本节约行动，同时利用我们有利的原料地位和参与有吸引力的终端市场，积极应对具有挑战性的近期宏观环境。

2、SMM 华东 3303#硅价格小幅走高。7 月 27 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，均价上调 50 元/吨。天津港、黄埔港、昆明、上海地区 3303#硅价小幅上调，其余地区硅价持稳。97 硅和金属硅粉价格也持稳运行。

3、研究：美国半导体行业到 2030 年将面临严重的劳动力短缺。近日，美国半导体行业协会(SIA)与牛津经济研究院(Oxford Economics)合作的一项研究表明，美国半导体行业到 2030 年将面临严重的劳动力短缺，缺口将达 6.7 万个。

三、相关图表概览

图1：工业硅期现价格（活跃合约）（单位：元/吨）

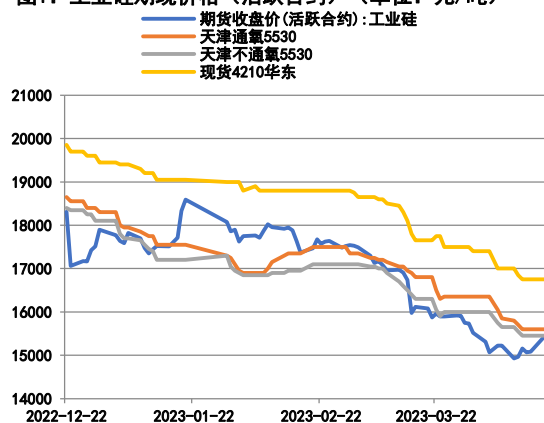


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

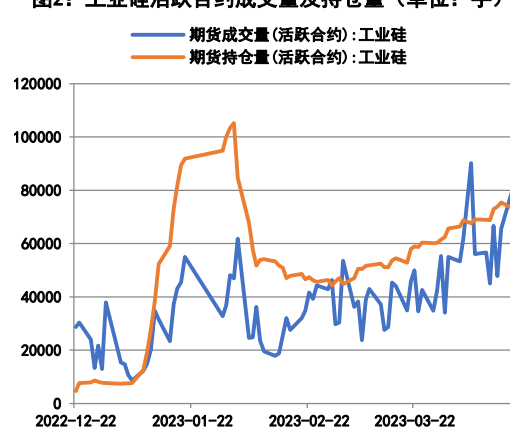


图3：基差（S08）

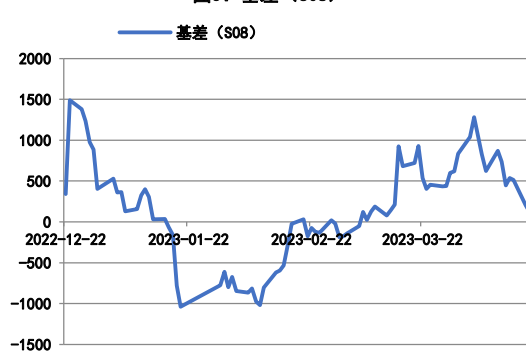


图4：基差（S09）

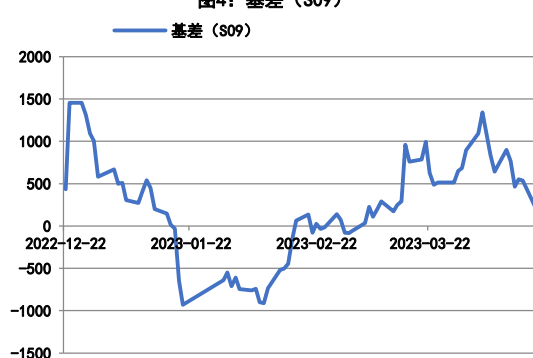


图5：基差（S10）



图6：8-9价差

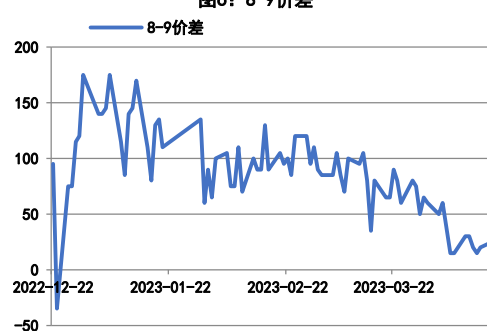


图7：8-10价差

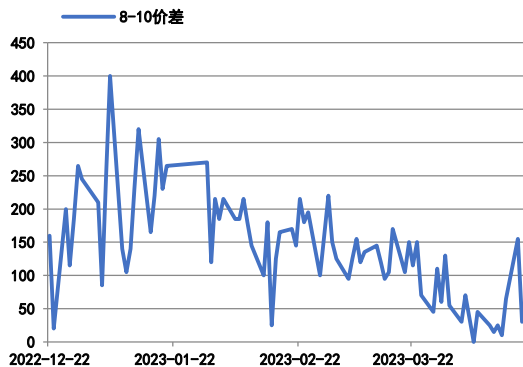
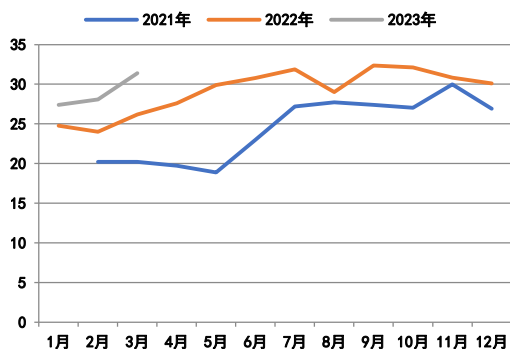


图8：工业硅产量（单位：万吨）



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 7 月 27 星期四，工业硅期货偏弱震荡，主力合约 2309 下跌 0.8%至 13570 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，四川地区部分硅厂停产，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。

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。