

工业硅日报：期货价格延续跌势 整体产量维持高位

2023 年 10 月 27 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	上一日	今日	涨跌量	涨跌幅
期货	SI2312 (主力)	收盘价	2023/10/27	元/吨	14150	13995	-155	-1.10%
		成交量	2023/10/27	手	72894	41612	-31282	-42.91%
		持仓量	2023/10/27	手	72215	69862	-2353	-3.26%
	SI2401价格		2023/10/27	元/吨	14210	14060	-150	-1.06%
	SI2402价格		2023/10/27	元/吨	14270	14095	-175	-1.23%
	SI2403价格		2023/10/27	元/吨	14315	14170	-145	-1.01%
现货	不通氧5530 (华东)		2023/10/27	元/吨	14450	14400	-50	-0.35%
	通氧5530 (华东)		2023/10/27	元/吨	15150	15100	-50	-0.33%
	4210 (华东)		2023/10/27	元/吨	15900	15850	-50	-0.31%
价差	基差	SI2312基差	2023/10/27	元/吨	300	405	105	35.00%
		SI2401基差	2023/10/27	元/吨	300	405	105	35.00%
		SI2402基差	2023/10/27	元/吨	180	305	125	69.44%
		SI2403基差	2023/10/27	元/吨	135	230	95	70.37%
		01-02价差	2023/10/27	元/吨	-120	-100	20	-16.67%
		01-03价差	2023/10/27	元/吨	-165	-175	-10	6.06%

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 华东部分工业硅价格下调，SMM 华东不通氧 553#在 14300-14500 元/吨，均价下调 50 元/吨。通氧 553#在 15000~15200 元/吨，均价下调 50 元/吨。521#在 15400~15500 元/吨。441#在 15300~15600 元/吨，均价下调 50 元/吨。421#在 15800~15900 元/吨，均价下调 50 元/吨。421#有机硅用在 16200-16400 元/吨。3303#在 15900-16100 元/吨，均价下调 50 元/吨。昆明、天津港地区硅价下调。黄埔港、四川、上海地区部分硅价小幅走低。新疆、福建地区硅价持稳。97 硅今日价格小幅走低。

2、今年全球硅晶圆出货量预计下降 14%，2024 年将迎来反弹，国际半导体产业协会 SEMI 表示，受半导体需求的持续疲软和宏观经济状况影响，2023 年全球硅晶圆出货量预计将下降 14%。按面积计算，2022 年全球晶圆出货量创下

历史记录，达到 145.65 亿平方英寸（MSI），预计 2023 年将降至 125.12 亿平方英寸。机构预测，随着人工智能（AI）、高性能计算（HPC）、5G、汽车和工业等应用带动硅芯片需求的增长，预计 2024 年全球硅晶圆出货量将反弹 8.5%，达到 135.78 亿平方英寸。预计这种反弹势头将持续到 2026 年，预计出货量将超过 16.2 亿平方英尺。

3、新疆加强硅石资源勘探 年内新立硅石采矿权众多。新疆维吾尔自治区矿产资源总体规划（2021-2025 年）中，规定了加快硅质原料勘察开采，硅质原料预期勘察计划目标到 2025 年为 1 亿吨。硅质原料到 2025 年开采总量规划目标为 500 万吨。在总体规划的政策加持下，今年以来，新疆加大矿业权出让力度。截至目前，已公开出让探矿权 13 批次 126 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）

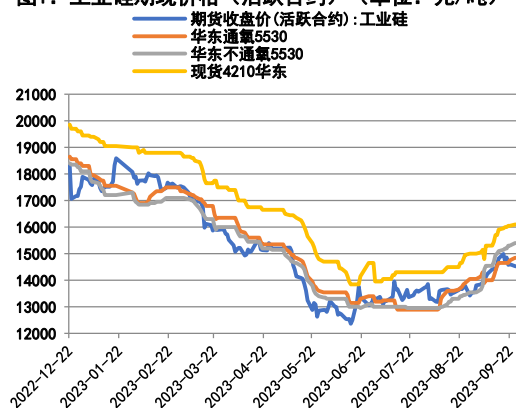


图2：工业硅活跃合约成交量及持仓量（单位：手）

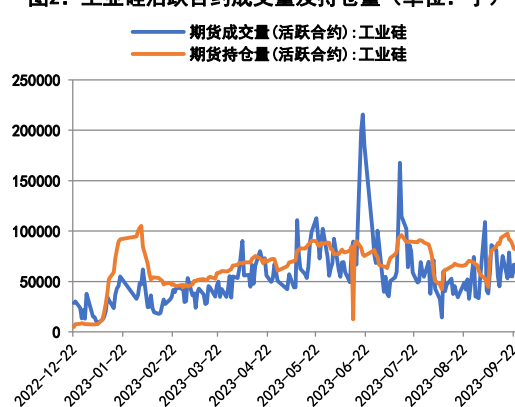


图3：基差（S10）

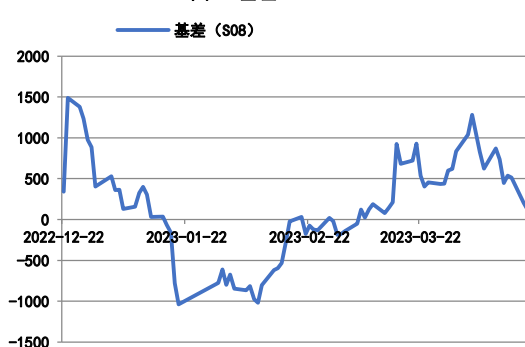
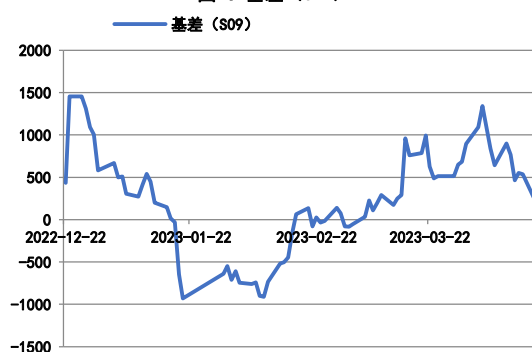
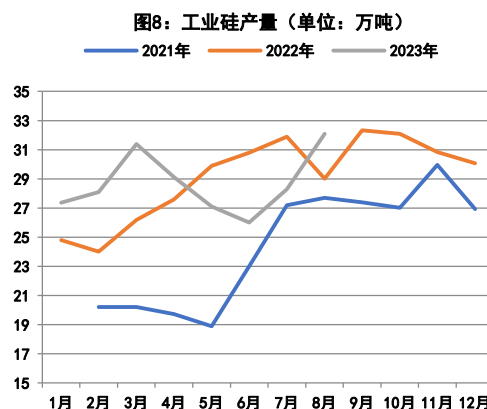
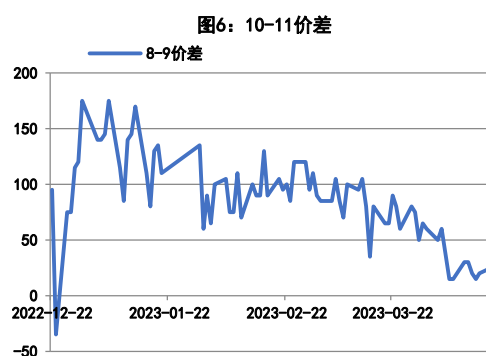
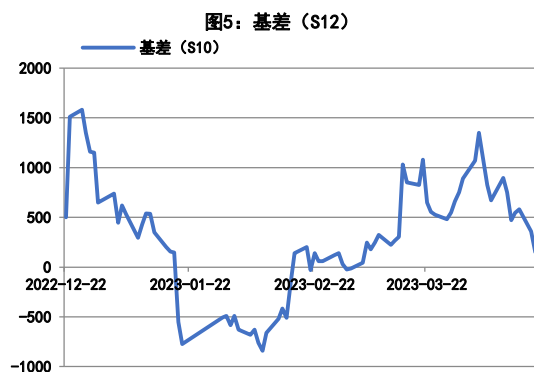


图4：基差（S11）





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10月27日星期五,工业硅期货延续跌势,主力合约收跌0.92%至13995元/吨。大厂复产叠加多晶硅产业链价格下行,市场情绪受到影响。目前工业硅整体产量维持高位,西北产区逐渐复产,西南产区受枯水期到来成本支撑影响,现货价格较为坚挺。现货方面,工业硅现货价格继续下跌。下游需求端,有机硅下游按需备货为主,交投情况一般,后期存看跌心态。多晶硅价格止跌企稳,光伏产业链价格持续走弱,市场成交情况一般,对于工业硅需求较为稳定。铝合金价格偏弱运行,下游观望心态延续,市场交投氛围冷清。总体来看,工业硅市场成交略有不足,气氛较为冷清,但近期成本可能上涨,预计对于工业硅价格形成一定支撑。



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。