

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	AL主力合约收盘价(日,元/吨)	18300	-205↓	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2252	-8.5↓
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	105	10↑	LME铝注销仓单(日,吨)	81925	-1525↓
	期货持仓量:铝(日,手)	375899	6805↑	LME铝库存(日,吨)	308375	31325↑
	沪铝前20名净持仓(日,手)	2684	3325↑	沪伦比值	8.19	0.17↑
	上期所仓单(日,吨)	81975	924↑	上期所库存(周,吨)	204063	-501↓
现货市场	上海有色网 A00铝(日,元/吨)	18400	0	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	-40	0
	长江有色市场A00铝(日,元/吨)	18390	-10↓	LME铝升贴水(日,美元/吨)	-6.25	-11.5↓
	AL主力合约基差(日,元/吨)	100	205↑	上海电解铝: CIF(提单)平均溢价	135	0
上游情况	西北地区预焙阳极(日,元/吨)	7635	0	氧化铝产量(月,万吨)	708.2	-23.46↓
	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2935	-1.67↓	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	29.9	-0.6↓
产业情况	WBMS铝供需平衡(月,万吨)	-89.5	-121.4↓	电解铝社会库存(日,万吨)	63.5	0
	原铝进口数量(月,吨)	50951.95	22584.58↑	电解铝总产能(月,万吨)	4397.1	12↑
	原铝出口数量(月,吨)	6671.04	1608.15↑	电解铝开工率(月,%)	93	0.61↑
下游情况	铝材产量(月,万吨)	533.48	-16.67↓	出口数量:未锻轧铝及铝材(月,万吨)	65.22	4.48↑
	铝合金产量(月,万吨)	112.3	7.9↑	出口数量:铝合金:当月值(月,万吨)	2.55	0.85↑
	汽车产量(月,万辆)	245.5	-4.4↓	国房景气指数(月)	95.26	-0.14↓
期权市场	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	19.16	-2.64↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	19.92	-0.35↓
	平值期权20日历史波动率(日,%)	25.37	0.05↑	平值期权40日历史波动率(日,%)	25.23	-1.38↓
行业消息	<p>1、近期,随着俄气断供、欧洲能源危机愈演愈烈,欧洲当地的铝业正面临着前所未有的“生存危机”。欧洲最大铝冶炼厂法国敦刻尔克铝业公司(Aluminium Dunkerque Industries France)周二宣布减产22%,成为电价飙升引发的减产浪潮中的最新一例。欧洲铝业的高管们近期频频警告称,能源成本飙升正威胁到该行业的生存。敦刻尔克铝业公司首席执行官Guillaume De Goys在接受采访时表示,该公司下周一将开始关闭部分产能,并在10月1日前完成整个程序。至于何时恢复,还尚未可知。</p> <p>2、SMM:铝是全球最重要的工业金属之一,伦敦金属交易所(LME)铝库存大幅增加,进一步证明市场对这种金属的需求正在减弱,而一些主要买家正试图避开俄罗斯的供应。LME铝库存周二飙升11%,为2月份以来的最大涨幅,并从8月份触及的30年低点反弹。与其他几种金属一样,铝几个月来一直受到现货供应紧张和对经济前景恶化的担忧的影响。越来越多的迹象表明,消费正受到影响,这可能导致更多铝流入LME。LME通常被视为“最后的市场”。两名不愿透露姓名的高级铝交易员表示,一些买家已经要求将今年的采购合同延至2023年。</p>				 <p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结	<p>宏观上,美国8月ISM非制造业PMI强于预期,市场对美联储9月加息75bp的预期再起,美元继续创20年高点,施压有色金属价格。供应端,欧洲能源危机短期无法改善,电价高企,用电较大的铝冶炼厂因生产成本高昂持续规模减产概率大增,消息称一年内海外累计减产或达到135万吨,约占全球产能1.7%;国内西南地区疫情静态管理,贵阳地区氧化铝流通货源趋紧;川渝地区电解铝冶炼厂复产缓慢,SMM调研表示最快或许能在10月底恢复供应;市场前段时间预期的云南因用电影响有减产暂时不会发生。需求方面,今日下游总体成交平稳,总体需求端维持疲软格局。库存上,国内外均偏低,LME铝库存最近有所增量,需求堪忧。总体上,美联储加息周期未结束,宏观情绪近期反复不定,海内外供应端增速都将放缓,海外需求下降,国内需求复苏程度有待验证,铝价多空交织,沪铝期价今日震荡偏弱。操作上建议,沪铝主力AL2210合约短期区间18150-18650低买高卖,止损各100点,注意风险控制。</p>				 <p>更多观点请咨询!</p>	
提示关注						

1

2