

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)	18460	155↑	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2203	13↑
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	105	-20↓	LME铝注销仓单(日,吨)	34875	-1650↓
	期货持仓量:铝(日,手)	352425	-5684↓	LME铝库存(日,吨)	562550	81175↑
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-14450	-1621↓	沪伦比值	8.36	-0.04↓
	上期所仓单(日,吨)	109147	-2851↓	上期所库存(周,吨)	186804	12293↑
现货市场	上海有色网 A00铝(日,元/吨)	18440	50↑	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	20	20↑
	长江有色市场 A00铝(日,元/吨)	18430	40↑	LME铝升贴水(日,美元/吨)	-16	-4.51↓
	AL主力合约基差(日,元/吨)	-20	-105↓	上海电解铝: CIF(提单)平均溢价	110	0
上游情况	西北地区预焙阳极(日,元/吨)	7815	0	氧化铝产量(月,万吨)	718.4	10.2↑
	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2808.33	-10↓	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	31	5.1↑
产业情况	WBMS铝供需平衡(月,万吨)	-91.6	-2.1↓	电解铝社会库存(日,万吨)	63.2	1.2↑
	原铝进口数量(月,吨)	9124.51	1827.44↓	电解铝总产能(月,万吨)	4410.1	6↑
	原铝出口数量(月,吨)	5253.67	1417.37↓	电解铝开工率(月,%)	91.61	-1.92↓
下游情况	铝材产量(月,万吨)	530.4	-3.08↓	出口数量:未锻轧铝及铝材(月,万吨)	54.04	-11.18↓
	铝合金产量(月,万吨)	108.2	-4.1↓	出口数量:铝合金:当月值(月,万吨)	1.95	-0.6↓
	汽车产量(月,万辆)	267.2	27.7↑	国房景气指数(月)	95.07	-0.19↓
期权市场	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	19.45	1.02↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	17.42	-1.3↓
	平值期权20日历史波动率(日,%)	21.64	-0.13↓	平值期权40日历史波动率(日,%)	22.17	-0.19↓
行业消息	<p>1、近日,山西省生态环境厅生态环境执法局发布《关于进一步强化秋冬季空气质量保障执法监管工作措施的通知》。根据《通知》要求,山西氧化铝行业企业属于重点监管单位,且行业企业辐射多个重点产业集群区,此次监管实施对该省企业安全生产提出更高要求。参考去年监管及目前政策要求来看,在监管期间,山西氧化铝企业将执行差异化减排措施。据数据统计,截止到2022年10月中旬,山西氧化铝建成产能达到2595万吨,产能利用率为66%左右,超七成企业已经处于减停产状态,30%以上的产能尚在停产中,区域整体运行并不高,可再减产比例较为有限。</p> <p>2、据Mysteel,文山州加快推进绿色能源和先进制造业深度融合,成功引进魏桥、神火、中铝等一批龙头企业,产业集群效应不断显现。目前,全州绿色铝产能达343万吨、再生铝产能达100万吨,绿色铝总产能占全省近二分之一、全国近十分之一,文山正向“中国绿色铝谷”核心区加速迈进。</p>					 更多资讯请关注!
观点总结	<p>供应端,海外能源扰动因素较多,减停产的铝冶炼厂短期较难恢复正常生产;国内方面,铝土矿受北方疫情影响运输,整体供不应求,市场成交较为有限;电解铝方面内蒙古有新增产能投产,四川复产速度慢于计划,云南减产暂无扩大,但云南部分恢复时间更长,供应端缓慢修复。需求端,上周下游开工已恢复至长假前水平,工业型材和汽车相关订单增加,光伏基建表现亮眼,10月仍处旺季消费段,政策方面下调首付利率等利好房地产,但近期疫情多发,部分地区铝加工企业开工或有不足,“金九银十”已过大部分,旺季表现低于往期,长期需求存疑。库存上,国内外均处低位,随着在途铝锭持续到货,国内呈现阶段累库,LME库存大增,传大宗商品巨头嘉能可已向LME仓库提供大量俄罗斯铝,虽对LME库存大增的说法不一,但海外多国激进加息下中长期全球需求预期悲观,国内外铝价承压。操作上建议,沪铝主力AL2211合约短线区间交易为主,注意操作节奏及风险控制。</p>					 更多观点请咨询!
提示关注						