



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)	18880	255↑	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2300	23↑
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	85	20↑	LME铝注销仓单(日,吨)	72500	-1625↓
	期货持仓量:铝(日,手)	420168	29939↑	LME铝库存(日,吨)	345600	12700↑
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-3208	10241↑	沪伦比值	8.18	0.05↑
	上期所仓单(日,吨)	107883	18823↑	上期所库存(周,吨)	194917	-9146↓
现货市场	上海有色网 A00铝(日,元/吨)	18790	160↑	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	-40	-10↓
	长江有色市场 A00铝(日,元/吨)	18790	170↑	LME铝升贴水(日,美元/吨)	-14.5	0.25↑
	AL主力合约基差(日,元/吨)	-90	-95↓	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)	2920.33	-13↓	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	27.8	-2.1↓
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)	63.9	1.6↑
	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)	54.04	-11.18↓
	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)	239.5	-6↓	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,%)	19.37	-0.38↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	19.89	-0.97↓
	平值期权20日历史波动率(日,%)	23.14	-0.07↓	平值期权40日历史波动率(日,%)	23.86	0.05↑
行业消息	<p>1、据SMM,近期云南多家铝厂响应区域内用能管理,停槽减产10%左右,但云南电力仍显紧张,今日调研获悉,部分铝厂反馈企业减产规模或将扩大,但减产幅度尚未明确,或达20-30%幅度。8月底云南电解铝运行总产能521万吨,后续减产规模若扩大至20%-30%,则云南相应的电解铝减产产能或扩大至100-150万吨,减产时间或到明年丰水期才能结束。</p> <p>2、欧盟委员会建议各成员国在高峰用电时段强制减少5%的用电量,总体用电量减少10%。将电力企业的“边际收入”上限定为每兆瓦180欧元。使用燃油、天然气和煤炭的发电企业在今年获得的利润如果超过以往三年平均利润的20%,超出部分的收入将被政府临时征收以补贴消费者。</p>					 更多资讯请关注
观点总结	<p>宏观上,美国通胀数据超出市场预期,美联储激进加息的步伐很难停止,美元指数高位震荡。供应端,海外天然气问题延续,减停产的铝冶炼厂较难恢复正常生产;国内川渝地区电解铝冶炼厂缓慢复产,或许能在10月底恢复减产前供应;云南枯水期影响限电停槽,电解铝生产企业限产10%,但消息称后续云南减产规模或将扩大,且减产时间需到明年丰水期,国内外供应端的扰动不断,对铝价有较强支撑。需求方面,“金九银十”消费预期受到8月CPI、PPI数据和政策提振,但需求复苏需要时间,上周下游龙头企业开工率小幅下滑,今日交投氛围热烈,需求跟随盘面回暖。库存上,国内外均偏低。总体上,宏观承压背景下,海内外供应端增速都将放缓,市场交易点或保持在供应端扰动上。操作上建议,短期投资者手中多单可以设好止盈,谨慎持有。</p>					 更多观点请咨询
提示关注						



180



181