

撰写人:陈一兰 从业资格证号:F3010136 投资咨询从业证书号:Z0012698

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)	18925	145↑	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2439.5	-18.5↓
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	45	15↑	LME铝注销仓单(日,吨)	224100	-5250↓
	期货持仓量:铝(日,手)	418370	-2073↓	LME铝库存(日,吨)	544025	-5250↓
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-4361	3894↑	沪伦比值	7.7	0.07↑
	上期所仓单(日,吨)	59110	4751↑	上期所库存(周,吨)	136460	-25180↓
现货市场	上海有色网 A00铝(日,元/吨)	18780	0	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	-50	-40↓
	长江有色市场A00铝(日,元/吨)	18790	0	LME铝升贴水(日,美元/吨)	-25	-7.25↓
	AL主力合约基差(日,元/吨)	-145	-145↓	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)	7835	0	氧化铝产量(月,万吨)	705.2	-13.2↓
	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2788.33	-3.34↓	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	43	3.8↑
产业情况	WBMS铝供需平衡(月,万吨)	-79.7	11.9↑	电解铝社会库存(日,万吨)	52.1	-0.9↓
	原铝进口数量(月,吨)	4666.92	5542.41↑	电解铝总产能(月,万吨)	4417.6	7.5↑
	原铝出口数量(月,吨)	1376.35	3877.32↓	电解铝开工率(月,%)	90.04	-1.57↓
下游情况	铝材产量(月,万吨)	543.2	12.8↑	出口数量:未锻轧铝及铝材(月,万吨)	49.6	-4.44↓
	铝合金产量(月,万吨)	109.8	1.6↑	出口数量:铝合金:当月值(月,万吨)	2.18	0.23↑
	汽车产量(月,万辆)	267.2	27.7↑	国房景气指数(月)	94.86	-0.21↓
期权市场	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	18.35	1.47↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	18.74	1.28↑
	平值期权20日历史波动率(日,%)	20.12	-1.54↓	平值期权40日历史波动率(日,%)	20.82	-0.64↓
行业消息	1.10月,中国社会消费品零售总额40271亿元(人民币,下同),同比下降0.5%,连续两个月增速回落。 2.北京时间15日21:30,美国10月PPI数据将公布,市场预期PPI年率增长8.3%,核心PPI年率增长7.2%。					
观点总结	宏观上,随着近期各项经济数据出炉,市场对美联储加息步伐放缓的预期持续升温,美元大幅下滑,有色提振;伦敦金属交易所表明不对俄罗斯金属施加禁令;国内疫情防控政策调整及政策对房地产支持利好。基本面上,国内铝土矿供应仍较紧,氧化铝价格部分区域跌幅仍在扩大,亏损产能占比较高,后期高成本企业或有减产可能,对铝土矿的需求或减少;电解铝方面海外再传减产消息,市场预计海外减产产能达200万吨左右;国内在云南、河南减产暂无新的减产消息,其他地区复产及新投产均不及预期,供应端压力趋缓。需求端,疫情影响此消彼长,上周铝下游加工龙头企业开工率环比上涨0.1个百分点,其中铝型材开工表现较好,但主要都是主要产区疫情缓解后工厂复产,而淡季到来,主要消费地区需求仍受疫情扰动,下游接货情绪不高,刚需为主,但需求在房地产利好上有改善预期。库存上,国内外均处低位,近期宏观利好加上低库存下去库,是推动沪铝上行的因素,疫情缓解后集中到货或有累库预期,而需求上仍需持续观察,或限制涨幅。沪铝AL2212合约短期轻仓震荡偏多思路为主,注意操作节奏及风险控制。					
提示关注	今日暂无消息					

数据来源第三方,观点仅供参考。市场有风险,投资需谨慎!



更多观点请咨询!