

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)	18670	20↑	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2248.5	-6.5↓
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	60	-10↓	LME铝注销仓单(日,吨)	67425	-300↓
	期货持仓量:铝(日,手)	401771	-6940↓	LME铝库存(日,吨)	346025	-300↓
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-12206	1733↑	沪伦比值	8.27	-0.05↓
	上期所仓单(日,吨)	100584	-4429↓	上期所库存(周,吨)	206945	12028↑
现货市场	上海有色网 A00铝(日,元/吨)	18550	-140↓	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	-50	0
	长江有色市场 A00铝(日,元/吨)	18540	-150↓	LME铝升贴水(日,美元/吨)	-19.75	-6.75↓
	AL主力合约基差(日,元/吨)	-120	-160↓	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)	718.4	10.2↑
	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2911.67	-3.33↓	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	27.9	0.1↑
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)	63.6	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)	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)	95.07	-0.19↓
期权市场	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	18.26	-1.74↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	20.32	0.22↑
	平值期权20日历史波动率(日,%)	20.96	-0.09↓	平值期权40日历史波动率(日,%)	23.83	-0.17↓
行业消息	<p>1、多地房贷利率持续下调。贝壳研究院数据显示,2022年9月贝壳监测的103个重点城市主流首套房贷利率为4.15%,二套房利率为4.91%,分别较上月回落17个、15个基点。截至9月19日,贝壳监测的103城中已有86城首套房按4.10%最低利率标准执行,二套房按4.90%最低利率标准执行。</p> <p>2、由于难以找到买家,俄铝正在制定一项直接向伦敦金属交易所(LME)在亚洲的仓库交付铝的计划。俄铝讨论过将部分铝从俄罗斯远东的符拉迪沃斯托克港运往LME亚洲仓库。俄铝目前仅考虑将一小部分产量运往LME仓库来进行测试,因为该公司也担心LME库存大量增加可能会压低价格。俄铝虽未受到美国等西方国家的制裁,但由于一些欧洲和美国的大型铝用户拒绝继续购买该公司的金属,俄铝也遭受到了冲击。</p>					
观点总结	<p>宏观上,美联储加息在即,美元指数高位运行,市场在加息落地前较谨慎。供应端,欧洲天然气期价高位回调,短期缓解了市场对海外电解铝持续大规模减产的忧虑,国内并未有云南地区电解铝厂进一步减产的消息,目前仍然压产10%。需求上,上周国内铝下游加工龙头企业周度开工率环比小幅上涨0.4个百分点,消费旺季表现未显现,宏观有利空风险,下游观望情绪较浓,现货刚需接货为主。库存上,海内外近日小幅去库。总体而言,近期关注点在美联储议息会议上,若加息结果符合市场预期的75个基点,宏观情绪得到短期缓解,沪铝在供应预期差下或进一步走强,若加息结果超预期,市场担忧需求恶化将承压铝价,但衰退逻辑贯穿全年,压制短期供应扰动打开的上行高度。盘面上,沪铝AL2210合约近日维持宽幅震荡,操作上建议,加息落地前暂时观望。</p>					
提示关注						

数据来源第三方,观点仅供参考。市场有风险,投资需谨慎!

更多资讯请关注!

更多观点请咨询!

