

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)	18895	-30↓	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2437	-2.5↓
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	30	-15↓	LME铝注销仓单(日,吨)	221450	-2650↓
	期货持仓量:铝(日,手)	421736	3366↑	LME铝库存(日,吨)	538825	-5200↓
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-1021	3340↑	沪伦比值	7.77	0.07↑
现货市场	上期所仓单(日,吨)	56464	-2646↓	上期所库存(周,吨)	136460	-25180↓
	上海有色网A00铝(日,元/吨)	18850	70↑	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	10	60↑
	长江有色市场AOO铝(日,元/吨)	18850	60↑	LME铝升贴水(日,美元/吨)	-27.75	-2.75↓
上游情况	AL主力合约基差(日,元/吨)	-45	100↑	上海电解铝:CIF(提单)平均溢价	110	0
	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↓
产业情况	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2785	-3.33↓	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	43	3.8↑
	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↑
下游情况	原铝出口数量(月,吨)	1376.35	3877.32↓	电解铝开工率(月,%)	90.04	-1.57↓
	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↑
期权市场	汽车产量(月,万辆)	259.88	-7.32↓	国房景气指数(月)	94.7	-0.16↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	17.57	-0.78↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	17.83	-0.91↓
	平值期权20日历史波动率(日,%)	20.14	0.02↑	平值期权40日历史波动率(日,%)	20.73	-0.09↓
行业消息	1.德国周二表示,受一段反常温暖天气的影响,该国的天然气储存设施已经完全满了。					
	2.英国10月CPI同比增长11.1%前值10.1%,高于预期的10.7%并创历史新高;环比增长2%前值0.5%,高于预期的1.7%。					
观点总结	宏观上,美国通胀数据整体低于预期,市场对美联储加息步伐放缓的预期持续升温,美元承压运行,利好风险情绪。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、河南减产后暂无新的减产消息,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!