



撰写人:陈一三 从业资格证号:F3010136 投资咨询从业证书号:Z0012698

# 沪铝产业日报

2022-08-29

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)	18675	-185↓	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2435.5	0
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	0	-40↓	LME铝注销仓单(日,吨)	94425	-2100↓
	期货持仓量:铝(日,手)	381148	-9905↓	LME铝库存(日,吨)	278025	-2100↓
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-11782	1991↑	沪伦比值	7.57	-0.19↓
现货市场	上期所仓单(日,吨)	96785	-779↓	上期所库存(周,吨)	204564	6678↑
	上海有色网A00铝(日,元/吨)	18960	100↑	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	-30	-10↓
	长江有色市场AOO铝(日,元/吨)	18960	110↑	LME铝升贴水(日,美元/吨)	9.25	-1↓
上游情况	AL主力合约基差(日,元/吨)	285	285↑	上海电解铝:CIF(提单)平均溢价	135	0
	西北地区预焙阳极(日,元/吨)	7700	0	氧化铝产量(月,万吨)	708.2	-23.46↓
	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2940	0	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	30.5	-3.4↓
产业情况	WBMS铝供需平衡(月,万吨)	31.9	-8.1↓	电解铝社会库存(日,万吨)	63.1	-1.1↓
	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)	65.22	4.48↑
	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)	245.5	-4.4↓	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,%)	20.53	16.44↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	20.92	17.18↑
	平值期权20日历史波动率(日,%)	22.76	-2.23↓	平值期权40日历史波动率(日,%)	25.94	0.09↑
行业消息	<p>1、北京时间周五(8月26日)22点,美联储主席鲍威尔在杰克逊霍尔全球央行年会上发表讲话,在某种程度上,随着政策立场进一步收紧,放慢加息步伐将是适当的。更高的利率会给家庭和企业带来痛苦。7月份的较低通胀数据值得欢迎,但还不足以让央行相信通胀正在下降,9月加息规模取决于“整体”数据,不会“过早”放松政策。</p> <p>2、财联社从国家电网了解到,随着气温下降,局部地区降雨,四川用电紧张的局面得到缓解。据介绍,28日四川水电日发电能力为4.6亿千瓦时,比前段时间最低值回升了9.5%。截至28日中午12点,四川省一般工商业用电已经全部恢复,除高载能行业外,大工业用电正在逐步恢复用电。后续水电来水持续好转后,大工业用电将全部恢复正常用电。</p>					
观点总结	<p>供应端减产消息频出,海外电力价格飙升屡创新高,利润空间的压缩使铝冶炼厂接连关闭,据悉过去一年已减少约50%,尖锐的能源危机问题短时间无法缓解,海外供应扰动将持续,供应端担忧情绪上升;国内新增和复产产能持续推进,电解铝的产能高位运行,川渝地区限电影响本周或有缓解,但电解铝企业复产缓慢,电解铝产量增速或维持小幅下降。需求方面,电力缓解后,下游工厂复产快速,近期多个政策利好房地产,汽车、电网数据向好,即将到来的金九银十有望给需求带来好转。库存上,国内外均偏低。总体上,沪铝期价今日高开低走。操作上建议,沪铝主力AL2210合约短期参考区间18400-19000低吸高抛,止损各100点,注意风险控制。</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!