

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)	18590	-60↓	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2325	17.51↑
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	70	-30↓	LME铝注销仓单(日,吨)	239425	-5225↓
	期货持仓量:铝(日,手)	394344	-8163↓	LME铝库存(日,吨)	558825	-5550↓
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-8012	2943↑	沪伦比值	8.08	0.21↑
现货市场	上期所仓单(日,吨)	52689	-677↓	上期所库存(周,吨)	161640	-16845↓
	上海有色网A00铝(日,元/吨)	18550	-60↓	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	-20	-20↓
	长江有色市场AOO铝(日,元/吨)	18550	-50↓	LME铝升贴水(日,美元/吨)	-15.11	0.33↑
上游情况	AL主力合约基差(日,元/吨)	-40	0	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	-13.21↓
	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2791.67	0	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	39.2	-2.21↓
产业情况	WBMS铝供需平衡(月,万吨)	-79.7	11.91↑	电解铝社会库存(日,万吨)	53	0.51↑
	原铝进口数量(月,吨)	64666.92	15542.41↑	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	12.81↑	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	1.61↑	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	27.71↑	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,%)	15.43	-0.79↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	17.45	1.54↑
	平值期权20日历史波动率(日,%)	23.29	0.16↑	平值期权40日历史波动率(日,%)	21.92	0.07↑
行业消息	1、据Miningmx报导, South32在其位于非洲的莫桑比克的 Mozaal 铝冶炼厂 (South32占股份63.7%) 发生事故, 造成两名员工死亡, 一名承包商受伤, 因此暂停了一条生产线 (Potroom A)。据SMM统计了解, Mozaal目前电解铝建成产能58万吨, 共包含其到2001年为止建成的2条生产线, 因此此次由于事故关闭其中一条生产线, 预计影响产能29万吨。据官网信息了解, 该厂的产品一部分供给当地下游, 同时供应给Midal Cables公司一定比例的铝水, 制成的产品销往国内外。之前海外共计减产产能173.8万吨, 计入本次Mozaal铝厂事故减产29万吨, 海外本年累计减产产能可达202.8万吨					
	2、近日, 山西省政府印发《关于深入打好污染防治攻坚战的实施意见》, 提出为全面贯彻落实《中共中央、国务院关于深入打好污染防治攻坚战的意见》, 进一步加强生态环境保护, 深入打好污染防治攻坚战, 全方位推动高质量发展。其中, 依法依规淘汰落后产能和化解过剩产能, 重点区域禁止新增钢铁、焦化、水泥熟料、平板玻璃、电解铝、氧化铝、聚氯乙烯、烧碱产能, 合理控制煤制油气产能规模。					
观点总结	宏观上, 最近的经济数据及市场预期美国2022中期选举会出现国会分立, 导致美联储加息的压力减轻, 最终结果仍需等待。供应端, 国内铝土矿供应仍较紧, 氧化铝有一半以上产能处于亏损, 后期高成本企业或有减产可能, 对铝土矿的需求或减少, 今日国内外铝土矿价格维稳, 无明显涨跌; 电解铝方面海外仍有减产发生, 国内河南部分电解铝企业因采暖季到来加上盈利不佳, 计划减产10%-15%, 北方部分区域因环保要求也有减产计划, 供应端扰动较多。需求端, 随着疫情影响逐渐消退, 上周铝下游加工龙头企业开工率环比上涨1.2个百分点, 现货资源紧张情况本周也有所缓解, 总体上旺季已过, 后期需求较难有较大亮眼表现, 今日各地铝锭仍是贴水, 下游少量刚需采购。库存上, 国内外均处低位, 国内疫情缓解, 集中到货后累库。即将发布美国通胀数据, 会对沪铝期价产生影响, 操作上建议, 观望为主。					
	提示关注 即将发布的美国通胀数据					

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!