


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)	18225	215↑	LME三个月铝15:00报价(日,美元/吨)	2405	-1.5↓
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	130	60↑	LME铝注销仓单(日,吨)	103825	-1500↓
	期货持仓量:铝(日,手)	363942	-17806↓	LME铝库存(日,吨)	275725	-1500↓
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-10349	5245↑	沪伦比值	7.49	-0.21↓
	上期所仓单(日,吨)	111320	-50↓	上期所库存(周,吨)	175792	-9566↓
现货市场	上海有色网 A00铝(日,元/吨)	18130	-100↓	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	0	220↑
	长江有色市场A00铝(日,元/吨)	18120	-100↓	LME铝升贴水(日,美元/吨)	0.5	-2.75↓
	AL主力合约基差(日,元/吨)	-95	-315↓	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)	7700	0	氧化铝产量(月,万吨)	731.66	32.91↑
	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2941.33	1.66↑	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	27.6	-2.3↓
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)	65.4	2.4↑
	原铝进口数量(月,吨)	28367.38	-8836.21↓	电解铝总产能(月,万吨)	4385.1	5↑
	原铝出口数量(月,吨)	5062.88	-59034.01↓	电解铝开工率(月,%)	92.39	0.35↑
下游情况	铝材产量(月,万吨)	550.15	14.55↑	出口数量:未锻轧铝及铝材:当月值(月,万吨)	65.22	4.48↑
	铝合金产量(月,万吨)	104.4	1.7↑	出口数量:铝合金:当月值(月,万吨)	1.7	-0.34↓
	汽车产量(月,万辆)	245.5	-4.4↓	国房景气指数(月)	95.4	-0.2↓
期权市场	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	24.67	4.63↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	23.95	2.66↑
	平值期权20日历史波动率(日,%)	24.94	1.1↑	平值期权40日历史波动率(日,%)	25.83	1.56↑
行业消息	1、按照《国务院办公厅关于营造良好市场环境促进有色金属工业调结构促转型增效益的指导意见》(国办发〔2016〕42号)和《工业和信息化部关于电解铝企业通过兼并重组等方式实施产能置换有关事项的通知》(工信部原〔2018〕12号)的相关要求,自治区工业和信息化厅于7月20日-8月2日对内蒙古联川铝业有限公司20万吨电解铝产能退出情况进行了公示,公示期间无异议,现予以公告。 2、中孚实业发布公告称,子公司广元林丰和广元中孚接到通知,部分产能需于2022年8月14日起停产一周。本次限电政策预计影响广元林丰电解铝产量约0.73万吨,影响广元中孚电解铝产量约0.56万吨。预计本次限电将对中孚实业带来共计0.78亿元的业绩影响,SMM数据显示,四川省电解铝产能合计107万吨/年,约占国内总产能的2.4%,上周统计有28万吨/年产能停产,昨日停产产能已提高至38万吨/年。					 更多资讯请关注!
观点总结	今日,电解铝成本17890元/吨,毛利润230元/吨,维持较低位。供应方面,国内新增和复产产能继续推进,但持续的高温天气影响电力供应问题,部分地区工业用电客户让电于民,鉴于电解铝的运行产能仍在高位运行,预计供应端的压力或有阶段性的小幅缓解。需求方面,下游订单疲弱,开工低迷,国房景气指数环比同比均减少,需求上维持淡季疲软局面。库存上,国内外均偏低,LME铝库存维持下降趋势,但国内铝锭库存已持续三周累库。总体上,供给阶段性小幅缓解,房地产数据低迷拖累需求叠加累库,预计沪铝宽幅震荡,沪铝主力合约AL2209今日减仓小幅反弹。操作上建议,沪铝主力AL2209合约短期在17900-18400区间低买高卖,止损各100点。					 更多观点请咨询!
提示关注	今日暂无消息					