



撰写人:陈一三 RUIDA FUTURES CO., LTD.

从业资格证号:F3010136 投资咨询从业证书号:Z0012698

沪铝产业日报

2022-09-01

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)	17900	-510↓	LME三个月15:00报价(日,美元/吨)	2321.5	-85.5↓
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	100	40↑	LME铝注销仓单(日,吨)	86925	-4300↓
	期货持仓量:铝(日,手)	374514	16929↑	LME铝库存(日,吨)	277050	-3425↓
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-310	1839↑	沪伦比值	7.79	0.09↑
现货市场	上期所仓单(日,吨)	95553	196↑	上期所库存(周,吨)	204564	6678↑
	上海有色网A00铝(日,元/吨)	18350	-90↓	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	-40	0
	长江有色市场AOO铝(日,元/吨)	18350	-90↓	LME铝升贴水(日,美元/吨)	10.25	1.25↑
	AL主力合约基差(日,元/吨)	450	420↑	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)	708.2	-23.46↓
	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2936.67	-3.33↓	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)	-89.5	-121.4↓	电解铝社会库存(日,万吨)	63.5	0.4↑
	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	7.91↑	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,%)	22.95	3.66↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	21.48	2.03↑
	平值期权20日历史波动率(日,%)	25.36	2.11↑	平值期权40日历史波动率(日,%)	26.32	0.96↑
行业消息	1、欧洲8国的国家元首或政府首脑及欧盟领导人,30日在丹麦首相官邸马林堡召开波罗的海能源峰会并签署“马林堡宣言”,同意加强能源安全和海上风电合作,计划在2030年将由其掌控的波罗的海地区海上风电装机容量从目前的2.8吉瓦提高至19.6吉瓦(1吉瓦等于100万千瓦),海上风电装机扩张6倍,国内海风企业海外订单迎机遇。 2、当地时间周三(8月31日),欧洲天然气价格一度大跌逾10%,交易员正在权衡欧洲的天然气储备是否足以安然度过今年冬季。业内人士指出,欧洲天然气储备进展超出预期,以及欧盟可能干预天然气和电力市场的消息,影响了天然气价格。随着欧洲提前两个月完成了天然气储备目标,市场担忧情绪部分缓解。根据欧洲天然气基础设施(Gas Infrastructure Europe)的数据,截至本周一,欧盟的天然气储气量已经达到了80.17%。此前,欧盟要求各成员国在11月1日前将天然气储气量填充至总容量的80%。					
观点总结	供应端,欧洲天然气储备进展超出预期,各国能源部长将于9月9日举行紧急会议讨论市场干预天然气及电力的措施,天然气期价大跌,后续需关注会议措施的干预程度;国内限电影响已消退,电解铝企业复产缓慢,供应端压力仍存。需求方面,电力缓解后,下游工厂复产快速;疫情散发,多地静态管理;铝锭华东市场交投略较昨日有好转,其余地区仍是成交平淡,需求端维持疲软格局。库存上,国内外均偏低,国内库存小幅累库。总体上,供应端产能高位运行,需求复苏仍需时间,宏观面偏空。盘面上沪铝期价近日受宏观和国内用电恢复影响较大,沪铝期价今日震荡下行。操作上建议,沪铝主力AL2210合约短期偏空思路,轻仓逢高做空,注意短线操作节奏及风险控制。					
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!