

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	AL2209合约收盘价(日, 元/吨)	18,270.00	-525.00↓	LME三个月铝收盘价(日, 美元/吨)	2,482.50	+17.50↑
	AL220-2210合约价差(日, 元/吨)	90.00	-5.00↓	LME铝注销仓单(日, 吨)	145,675.00	-3300.00↓
	沪铝总持仓量(日, 手)	403,151.00	-552.00↓	LME铝库存(日, 吨)	291,025.00	-4300.00↓
	沪铝前20名净持仓(日, 手)	-13,014.00	-5000.00↓	沪伦比值	7.57	-0.05↓
现货市场	上期所仓单(日, 吨)	62,123.00	-877.00↓	上期所库存(周, 吨)	185,358.00	-5840.00↓
	上海有色网A00铝(日, 元/吨)	18,300.00	-320.00↓	上海物贸铝升贴水(日, 元/吨)	-20.00	+10.00↑
	长江有色市场A00铝(日, 元/吨)	18,280.00	-330.00↓	LME铝升贴水(日, 0-3, 美元/吨)	15.74	+6.99↑
上游情况	AL主力合约基差(日, 元/吨)	30.00	+205.00↑	上海电解铝:CIF(提单)平均溢价	135.00	0.00
	西北地区预焙阳极(日, 元/吨)	7,900.00	0.00	氧化铝产量(月, 万吨)	731.66	+32.86↑
	一级氧化铝均价(日, 元/吨)	2,950.00	0.00	氧化铝港口库存(日, 万吨)	27.30	+0.50↑
产业情况	WBMS铝供需平衡(月, 万吨)	40.00	-7.40↓	电解铝成本(日, 元/吨)	18,025.95	0.00
	电解铝社会库存(日, 吨)	616,000.00	-7000.00↓	电解铝毛利(日, 元/吨)	584.05	+250.00↑
	原铝进口数量(月, 万吨)	2.84	-0.88↓	电解铝总产能(月, 万吨)	4,385.10	+5.00↑
	原铝出口数量(月, 万吨)	0.51	-5.90↓	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↑	未锻造的铝及铝材出口量(月, 万吨)	60.74	-6.92↓
	铝合金产量(月, 万吨)	104.40	+1.70↑	铝合金出口量(月, 万吨)	1.70	-0.33↓
	汽车产量(月, 万辆)	249.92	+57.29↑	国房景气指数(月)	95.40	-0.20↓
期权市场	沪铝期货平值看涨期货波动率(日, %)	24.89	+1.82↑	沪铝期货平值看跌期货波动率(日, %)	27.48	+1.64↑
	沪铝平值期权20日历史波动率(日, %)	29.13	+1.81↑	沪铝平值期权40日历史波动率(日, %)	24.84	+1.40↑
行业消息	1、中国7月官方制造业PMI为49, 位于临界点以下, 制造业景气水平有所回落, 预期50.4, 前值50.2; 官方非制造业PMI为53.8, 预期53.8, 前值54.7, 资本市场服务、保险、房地产、租赁及商务服务等行业商务活动指数低于临界点。7月综合PMI产出指数为52.5, 仍高于临界点, 表明我国企业生产经营总体继续恢复性扩张。 2、据经济参考报, 在利好政策的加持下, 进入6月, 房地产市场明显好转, 热点城市和热点区域的销售复苏节奏加快, 供求略有好转。业内人士表示, 当前行业基本面的底部或已过去, 但总体来看, 房地产市场仍处销售边际改善的弱复苏阶段, 预计整体回暖还需时日。					
观点总结	美国二季度经济数据衰退, 美联储加息预期有所回落, 美元指数再度走弱。我国7月官方制造业PMI数据位于临界点以下, 制造业景气水平有所回落; 7月综合PMI产出指数高于临界点, 企业生产经营总体维持恢复性扩张。铝矿持续偏紧, 部分氧化铝企业计划减产, 短期氧化铝供应将明显减少。电解铝炼厂供应端投产速度大于减产, 产量持续上升。消费端持续疲软, 需求弱势局面短期难有改善。伦铝库存持续去库, 沪铝库存呈现小幅累库, 铝价上涨空间受限。盘面上, 沪铝主力合约期价大幅下挫, MACD红柱缩小。操作上, 建议18400以下偏空交易, 注意风险控制。					
重点关注						

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!

备注: AL:沪铝



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!