



沪铝产业日报

2022-08-18

撰稿人:陈一凡 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)	18330	-330↓	LME三个月铝15:00报价(日,美元/吨)	2383	-30.5↓
	AL主力-下月合约价差(日,元/吨)	145	-5↓	LME铝注销仓单(日,吨)	103475	-250↓
	期货持仓量:铝(日,手)	375068	-2092↓	LME铝库存(日,吨)	276875	1250↑
	沪铝前20名净持仓(日,手)	-5203	3929↑	沪伦比值	7.73	0.13↑
现货市场	上期所仓单(日,吨)	109144	-824↓	上期所库存(周,吨)	178736	2944↑
	上海有色网A00铝(日,元/吨)	18640	160↑	上海物贸铝升贴水(日,元/吨)	0	0
	长江有色市场AOO铝(日,元/吨)	18640	170↑	LME铝升贴水(日,美元/吨)	-2	1.75↑
上游情况	AL主力合约基差(日,元/吨)	310	490↑	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)	731.66	32.91↑
产业情况	一级氧化铝均价(日,元/吨)	2944.67	3.34↑	库存:氧化铝:总计(周,万吨)	27.6	-2.3↓
	WBMS铝供需平衡(月,万吨)	31.9	-8.1↓	电解铝社会库存(日,万吨)	65	1.1↑
	原铝进口数量(月,吨)	28367.38	-8836.21↓	电解铝总产能(月,万吨)	4397.1	12↑
下游情况	原铝出口数量(月,吨)	5062.88	59034.01↓	电解铝开工率(月,%)	93	0.61↑
	铝材产量(月,万吨)	550.15	14.55↑	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)	104.4	1.7↑	出口数量:铝合金:当月值(月,万吨)	1.7	-0.34↓
期权市场	汽车产量(月,万辆)	245.5	-4.4↓	国房景气指数(月)	95.26	-0.14↓
	平值看涨期权隐含波动率(日,%)	25.69	5.79↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	21.78	1.62↑
	平值期权20日历史波动率(日,%)	27.3	0.93↑	平值期权40日历史波动率(日,%)	26.53	0.32↑
行业消息	<p>1、据Mysteel, 全球铝业巨头挪威海德鲁(Norsk Hydro)宣布, 将于9月底关闭其位于斯洛伐克的铝冶炼厂。挪威海德鲁拥有该铝冶炼厂的多数股份。此次停产将于2022年9月底完成。该铝厂总产能17.5万吨/年, 因能源价格高企, 该铝厂于2021年底至2022年初已经减产40%。</p> <p>2、2022年7月份, 中国铝冶炼产业景气指数为57.8, 较上月下降1.6个点, 但处于“正常”区间上部; 先行合成指数为68.3, 较上月下降4.0个点。</p>					
观点总结	<p>供应方面, 海外能源危机扰动下, 接连关闭的冶炼厂, 让市场对电解铝持续规模减产的担忧加重; 国内新增和复产产能持续推进, 电解铝的运行产能高位运行, 限电持续发酵, 影响有扩大趋势, 电解铝产量增加速度放缓。需求方面, 国内淡季效应影响持续, 限电影响下游开工下滑, 需求延续弱势。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。成本方面变动不大, 今日电解铝成本17890元/吨, 毛利润750元/吨, 较昨日略涨, 但仍在较低位。总体上, 近两日沪铝受外盘铝价上涨带动表现强劲, 但消费低迷叠加累库压力限制其上涨空间。操作上建议, 沪铝主力AL2209合约短期暂时观望。</p>					
提示关注	今日暂无消息					

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!