

撰写人: 林静宜 从业资格证号: F0309984 投资咨询从业证书号: Z0013465

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	新加坡RSS3主力结算价(日,美分/公斤)	171.50	-5.40↓	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤)	151.90	-1.90↓
	沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)	11,965.00	+260.00↑	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	10,695.00	+335.00↑
	沪胶9-1价差(日,元/吨)	-1,145	-20.00↓	20号胶9-10价差(日,元/吨)	155	+115.00↑
	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	1,270	-75.00↓			
	沪胶主力合约持仓量(日,手)	166,481.00	-11311.00↓	20号胶主力合约持仓量(日,手)	52,264.00	-1092.00↓
	沪胶前20名净持仓	-42,757	-1156.00↓	20号胶前20名净持仓	-3,600	-934.00↓
	沪胶交易所仓单(日,吨)	258,740.00	+2910.00↑	20号胶交易所仓单(日,吨)	65086	-404.00↓
现货市场	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	11850	-300.00↓	上海市场越南3L(日,元/吨)	12,100.00	-200.00↓
	泰标STR20(日,美元/吨)	1585	+15.00↑	马标SMR20(日,美元/吨)	1,560.00	+15.00↑
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	12000	+150.00↑	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	11,950.00	+150.00↑
	齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)	12,000.00	0.00	齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)	13,300.00	0.00
	沪胶主力合约标准品基差(日,元/吨)	-115.00	-560.00↓	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	35.00	-110.00↓
	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	238	-42↓			
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	59.15	0.00	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	57.47	0.00
	泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)	53.00	0.00	泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)	47.00	0.00
	海南全乳原料(日,元/吨)	10,700.00	0.00	云南胶水进干胶厂(日,元/公斤)	10.90	-0.10↓
	海南乳胶原料(日,元/吨)	12,100.00	0.00	云南胶水进乳胶厂(日,元/公斤)	11.10	-0.20↓
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	103.78	-59.63↓	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	52.82	-54.69↓
	标胶月度进口量(5月,吨,%)	144,809.47	-0.31↓	混合胶月度进口量(5月,吨,%)	187719.36	+6.59↑
	标胶进口利润(日,美元/吨)	-40.00	+15.00↑	青岛地区天胶保税和一般贸易库存(周,万吨,%)	37.77	+2.27↑
期权市场	全钢胎开工率(周,%)	59.29	+1.64↑	半钢胎开工率(周,%)	65	+1.57↑
	重卡销量(6月,万辆,%)	5.30	+8.00↑			
行业消息	标的历史20日波动率(日,%)	21.80	-0.50↓	标的历史40日波动率(日,%)	24.50	+0.40↑
	平值看涨期权隐含波动率(日)	19.70	+0.20↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	18.65	-0.10↓
观点总结	未来第一周(2022年7月17日-7月23日)天然橡胶东南亚主产区降雨明显减少。其中柬埔寨、老挝、越南红色预警区域减少,相对缓和高位降雨带来的影响。目前中偏高位降雨主要集中在泰国、柬埔寨、老挝,要谨防持续性降雨对割胶工作带来的影响。					
	1、据隆众资讯统计,截至2022年07月10日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量37.77万吨,较上期增加0.84万吨,环比上涨2.27%,依旧处于僵持状态,同比缩减12.59万吨,跌幅25%。海外天胶产量提升,分流中国数量增加,预计本周青岛地区天胶现货库存存在增加可能。					
提示关注	2、QinRex据中国海关总署7月13日公布的数据显示,2022年6月中国进口天然及合成橡胶(含胶乳)合计53.6万吨,较2021年同期的46.2万吨增加16%。2022年1-6月中国进口天然及合成橡胶(含胶乳)共计339.6万吨,较2021年同期的329.4万吨增长3.1%					
	国内外主产区处于割胶期,泰国原料自6月份开始上量较快,但近期降雨偏多,原料价格维持平稳。国内云南版纳降雨较多,对割胶工作造成一定影响,但胶水分流减淡,全乳胶产量增加;海南目前割胶情况转好,基本上已陆续进入全面开割状态,胶水上量预期偏强,但浓乳成品成交不及预期,部分加工厂表示近期收胶意愿走低。近期青岛天然橡胶库存小幅增加,依旧处于增减僵持当中,考虑到进口陆续增加,入库量环比增加的可能,预计短期青岛地区库存有继续小幅累库的可能。需求方面,上周轮胎厂开工率环比小幅提升,但在成品库存高位压力下,短期仍存停产或降负安排。盘面上,ru2209合约减仓收涨,短线关注12100附近压力,建议在11700-12100区间交易。					
提示关注	周四隆众轮胎样本企业开工率					



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!