

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	V2209合约 (元, 日)	7,318.00	0.00	V主力合约成交量 (手, 日)	1,531,124.00	+113966.00↑
	V2210合约 (元, 日)	6,291.00	+2.00↑	V主力合约持仓量 (手, 日)	550,343.00	-13617.00↓
	V2209-V2210价差 (元, 日)	1,027.00	-2.00↓	PVC仓单 (张, 日)	2,700	-40.00↓
	V前20名持仓多头 (手, 日)	643780	-11314.00↓	V前20名净持仓 (手, 日)	-31099	+13133.00↑
	V前20名持仓空头 (手, 日)	707705	-17035.00↓			
现货市场	CFR东北亚PVC (美元, 周)	1492.00	+511.00↑	华东常州SG-5G型 (元, 日)	6717.27	-1416.06↓
	CFR东南亚PVC (美元, 周)	1551.00	+472.00↑	华东常州S-1000型 (元, 日)	6977.27	-1391.78↓
	PVC进口利润 (元, 周)	-5293.21	-42.73↓	V基差 (元, 日)	67.00	+126.00↑
上游情况	CFR东北亚乙烯 (美元, 周)	891	0.00	西北电石 (元, 日)	3849	+2.33↑
	CFR东北亚VCM (美元, 周)	800	0.00	兰炭中料市场价 (元, 日)	1,700.00	-80.00↓
	CFR东北亚EDC (美元, 周)	500	0.00	兰炭中料出厂价 (元, 日)	1,730.00	0.00
产业情况	PVC企业平均开工率 (% , 周)	80.17	+1.80↑	乙烯法企业开工率 (% , 周)	83.20	-0.95↓
	电石法企业开工率 (% , 周)	79.70	+2.62↑	PVC华东库存 (万吨, 周)	29.82	+0.08↑
	PVC社会库存 (万吨, 周)	37.12	+0.18↑	PVC华南库存 (万吨, 周)	7.30	+0.10↑
下游情况	新屋开工累计同比 (% , 月)	198895.05	-11.40↓	国房景气指数 (% , 月)	100.36	-0.15↓
	施工面积累计同比 (% , 月)	975386.51	5.20↑	销售面积累计 (万平方米, 月)	179433.41	+1.90↑
	竣工面积累计同比 (% , 月)	101411.939	11.20↑	PVC铺地制品出口 (吨, 月)	473142.82	+35780.56↑
期权市场	标的历史20日波动率 (% , 日)	38.48	+0.12↑	标的历史40日波动率 (% , 日)	31.45	+0.05↑
	平值看涨期权隐含波动率 (% , 日)	36.49	-1.31↓	平值看跌期权隐含波动率 (% , 日)	36.68	-0.95↓

行业消息

1、中国台湾台塑8月PVC预售报价公布, CFR中国大陆跌190在930美元/吨, CFR东南亚跌220在980美元/吨, CFR印度跌230美元/吨在1090美元/吨。FOB台湾下调200在880美元/吨。2、截止2022年7月15日, 中国PVC企业减损量在10.12万吨, 较上期减少1.34万吨, 环比减少11.71%, 装置检修结束复产, 减损量继续减少。



更多资讯请关注!

观点总结

截至7月14日当周, PVC生产企业周均开工率在80.17%, 环比增加1.80%, 同比减少2.22%; 其中电石法开工率79.66%, 环比增加2.62%, 同比减少2.34%; 乙烯法开工率83.19%, 环比减少0.95%, 同比减少3.04%。PVC产量在44.71万吨, 环比增加3.09%, 同比增加0.28%。PVC制品企业开工依然不佳, 硬制品行业维持较弱状态, 软制品企业开工变化不大。房地产数据低迷, 终端对型材与异型材需求有限, 个别企业有补库的需求。但仍需要关注下游订单的情况。型材制品库存维持偏上位置, 部分企业存在出货压力。由于宏观数据仍不佳, 预计下周下游需求仍将维持在一个相对低位。截至7月17日, 国内PVC社会库存存在37.12万吨, 环比增加0.49%, 同比增加158.14%; 其中华东地区在29.82万吨, 环比增加0.27%, 同比增加190.08%; 华南地区在7.3万吨, 环比增加1.39%, 同比增加78.05%。今日V2209反弹受阻, 阳十字报收, 显示其上有压力, 下有支撑。操作上, 投资者暂时观望为宜。



更多观点请咨询!

关注提示

周四隆众PVC库存、生产企业开工率、原料价格变化。

瑞达研究