

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)	170.90	-2.20↓	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤)	152.70	-0.20↓
	沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)	11,760.00	-130.00↓	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	10,830.00	+5.00↑
	沪胶9-1价差(日,元/吨)	-1,135	-20.00↓	20号胶9-10价差(日,元/吨)	260	+30.00↑
	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	930	-135.00↓			
	沪胶主力合约持仓量(日,手)	163,371.00	+759.00↑	20号胶主力合约持仓量(日,手)	49,693.00	-2869.00↓
	沪胶前20名净持仓	-41,395	-313.00↓	20号胶前20名净持仓	-4,267	-488.00↓
	沪胶交易所仓单(日,吨)	256,140.00	-490.00↓	20号胶交易所仓单(日,吨)	62970	-504.00↓
现货市场	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	11800	-150.00↓	上海市场越南3L(日,元/吨)	12,050.00	-100.00↓
	泰标STR20(日,美元/吨)	1630	+45.00↑	马标SMR20(日,美元/吨)	1,580.00	+20.00↑
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	11900	-50.00↓	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	11,850.00	-50.00↓
	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)	40.00	-20.00↓	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	140.00	+80.00↑
	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	172	+251↑			
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	58.11	-0.07↓	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	56.80	0.00
	泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)	52.50	0.00	泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)	47.75	-0.20↓
	海南全乳原料(日,元/吨)	10,700.00	-100.00↓	云南胶水进干胶厂(日,元/公斤)	10.70	-0.10↓
	海南乳胶原料(日,元/吨)	12,600.00	+300.00↑	云南胶水进乳胶厂(日,元/公斤)	10.80	-0.40↓
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	155.73	-0.04↓	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	52.06	-22.69↓
	标胶月度进口量(吨,%)	168,189.18	+0.16↑	混合胶月度进口量(吨,%)	260176.30	+39.78↑
	标胶进口利润(日,美元/吨)	-30.00	0.00	青岛地区天胶保税和一般贸易库存(周,万吨,%)	37.21	-1.48↓
	全钢胎开工率(周,%)	59.29	+1.64↑	半钢胎开工率(周,%)	65	+1.57↑
期权市场	重卡销量(6月,万辆,%)	5.30	+8.00↑			
	标的历史20日波动率(日,%)	23.20	-0.10↓	标的历史40日波动率(日,%)	11.60	+0.40↑
	平值看涨期权隐含波动率(日)	21.20	-0.11↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	23.52	+0.90↑

行业消息

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。

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%



更多资讯请关注!

观点总结

国内外主产区处于割胶期,泰国原料上量较快。国内云南版纳降雨偏多,割胶工作开展不畅,新鲜胶水产量偏低;海南目前基本上已陆续进入全面开割状态,胶水存上量预期。近期青岛天然橡胶库存小幅减少,依旧处于僵持当中,考虑到价格止跌的情况下,下游工厂采购可能小幅缩减,预计短期青岛地区库存有小幅累库的可能。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合约增仓收跌,短线关注前期低点附近支撑,建议在11650-11950区间交易。



更多观点请咨询!

提示关注 周四隆众轮胎样本企业开工率

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: ru: 天然橡胶 nr: 20号胶