

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	V2208合约 (元, 日)	7,744.00	-66.00↓	V主力合约成交量 (手, 日)	796,637.00	-69870.00↓
	V2209合约 (元, 日)	7,650.00	-101.00↓	V主力合约持仓量 (手, 日)	529,615.00	+11869.00↑
	V2208-V2209价差 (元, 日)	94.00	+35.00↑	PVC仓单 (张, 日)	3,727	-100.00↓
	V前20名持仓多头 (手, 日)	631865	+9530.00↑	V前20名净持仓 (手, 日)	-31099	+13133.00↑
	V前20名持仓空头 (手, 日)	677748	+16687.00↑			
现货市场	CFR东北亚PVC (美元, 周)	1492.00	+310.00↑	华东常州SG-5G型 (元, 日)	8541.67	-151.83↓
	CFR东南亚PVC (美元, 周)	1551.00	+283.00↑	华东常州S-1000型 (元, 日)	8790.91	-168.59↓
	PVC进口利润 (元, 周)	-3375.43	+31.60↑	V基差 (元, 日)	67.00	+126.00↑
上游情况	CFR东北亚乙烯 (美元, 周)	1011	0.00	西北电石 (元, 日)	3968	0.00
	CFR东北亚VCM (美元, 周)	1000	0.00	兰炭中料市场价 (元, 日)	1,900.00	0.00
	CFR东北亚EDC (美元, 周)	615	0.00	兰炭中料出厂价 (元, 日)	1,750.00	0.00
产业情况	PVC企业平均开工率 (% , 周)	76.40	-1.00↓	乙烯法企业开工率 (% , 周)	69.92	-5.07↓
	电石法企业开工率 (% , 周)	78.30	+0.08↑	PVC华东库存 (万吨, 周)	27.51	+0.94↑
	PVC社会库存 (万吨, 周)	33.91	+0.54↑	PVC华南库存 (万吨, 周)	6.40	-0.40↓
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)	22.73	+0.21↑	标的历史40日波动率 (% , 日)	21.73	-0.32↓
	平值看涨期权隐含波动率 (% , 日)	26.47	-1.05↓	平值看跌期权隐含波动率 (% , 日)	25.87	-0.32↓

行业消息

1、7月中国台湾台塑船期预售报价环比跌90美元/吨, CFR印度在1320美元/吨, 较当前市场低端价下调30美元/吨; CFR中国在1120美元/吨; FOB在1080-1100美元/吨针对不同区域。2、2022年5月国内PVC铺地材料出口47.31万吨, 环比增加8.17%, 同比增加6.96%。1-5月出口合计225万吨, 累计同比增加6.83%。PVC地板出口量继续平稳增长。



更多资讯请关注!

观点总结

截至2022年6月16日当周, PVC 生产企业开工率环比减少 1.01%在 76.40%, 同比下降 7.43%; 其中电石法环比增加 0.8%在 78.30%, 同比减少 5.17%; 乙烯法环比减少 5.08%, 同比减少 17.37%。PVC 产量在 42.20 万吨, 环比减少 1.30%, 同比减少 7.04%。PVC 制品企业开工维持较低状态, 硬制品行业订单仍然未见起色。根据统计局数据, 1-5月房企开发投资、新开工面积, 土地购置面积均呈现不同幅度的下滑; PVC 的需求恢复不足。下游成品库存偏高限制。企业面临销售压力。截至6月19日, 国内PVC社会库存在33.91万吨, 环比增加0.91%, 同比增加114.62%; 其中华东地区在27.51万吨, 环比增加2.63%, 同比增加145.63%; 华南地区在6.4万吨, 环比减少5.88%, 同比增加39.13%。今日V2209震荡走低, 显示空方仍占据优势。操作上, 投资者手中空单可以设好止损, 谨慎持有。



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