

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)	7,473.00	-271.00↓	V主力合约成交量 (手, 日)	918,970.00	+122333.00↑
	V2209合约 (元, 日)	7,381.00	-269.00↓	V主力合约持仓量 (手, 日)	561,395.00	+31780.00↑
	V2208-V2209价差 (元, 日)	92.00	-2.00↓	PVC仓单 (张, 日)	3,501	-226.00↓
	V前20名持仓多头 (手, 日)	659456	+27591.00↑	V前20名净持仓 (手, 日)	-31099	+13133.00↑
	V前20名持仓空头 (手, 日)	702681	+24933.00↑			
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)	8446.43	-247.07↓
	CFR东南亚PVC (美元, 周)	1551.00	+283.00↑	华东常州S-1000型 (元, 日)	8692.86	-266.64↓
	PVC进口利润 (元, 周)	-3473.48	+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)	25.27	+2.54↑	标的历史40日波动率 (% , 日)	23.03	+1.30↑
	平值看涨期权隐含波动率 (% , 日)	28.56	+2.09↑	平值看跌期权隐含波动率 (% , 日)	28	+2.13↑

行业消息

1、巴基斯坦关税委员会发布公告称, 应巴基斯坦聚氯乙烯树脂生产商Engro Polymer and Chemicals Limited于4月22日提交的申请, 对原产于或进口自中国大陆、中国台湾地区、韩国和泰国的悬浮级聚氯乙烯树脂启动第一次反倾销日落复审调查, 本案涉及巴基斯坦税号3904.1090项下的产品。2、节后归来, 电石市场依旧持续低迷, 受下游检修增多抑制价格上调。而成本兰炭受煤炭上行, 价格上调100元/吨, 增加电石生产成本, 生产企业亏损增加, 个别电石生产企业因库存消化滞后。



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程度的下滑; 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继续大幅下行, 显示空方仍占据优势。操作上, 投资者手中空单可以设好止盈, 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