



项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	9月合约收盘价:聚乙烯(日,元/吨)	8216	-16	5月合约收盘价:聚乙烯(日,元/吨)	8117	-23
	1月合约收盘价:聚乙烯(日,元/吨)	8165	-21	成交量(日,手)	170229	-88345
	持仓量(日,手)	285107	-3218	9月-1月合约(日,元/吨)	51	5
	期货前20名持仓:买单量:聚乙烯(日,手)	289260	441	期货前20名持仓:卖单量:聚乙烯(日,手)	312231	4902
	期货前20名持仓:净买单量:聚乙烯(日,手)	-22971	-4461			
现货市场	LLDPE(7042)均价:华北(日,元/吨)	8283.53	-16.47	LLDPE(7042)均价:华东(日,元/吨)	8317.56	7.07
	基差	67.53	-0.47			
上游情况	FOB:中间价:石脑油:新加坡地区(日,美元/桶)	70.63	-1.71	CFR:中间价:石脑油:日本地区(日,美元/吨)	658	-16.5
	乙烯:CFR东南亚:中间价(日,美元/吨)	931	0	乙烯:CFR东北亚:中间价(日,美元/吨)	858	0
产业情况	开工率:PE:石化:全国(日,%)	78.91	3.02			
下游情况	开工率:聚乙烯(PE):包装膜(周,%)	48.89	-0.37	开工率:聚乙烯(PE):管材(周,%)	30	-0.17
	开工率:聚乙烯(PE):农膜(周,%)	14.13	1.24			
期权市场	历史波动率:20日:聚乙烯(日,%)	7.23	-0.02	历史波动率:40日:聚乙烯(日,%)	8.08	0
	平值看跌期权隐含波动率:聚乙烯(日,%)	14.5	3.35	平值看涨期权隐含波动率:聚乙烯(日,%)	14.5	3.35

行业消息	1、隆众资讯: 8月6日两油聚烯烃库存81.5万吨, 较昨日减少1.5万吨。 2、隆众资讯: 截止到2024年8月2日, 聚乙烯社会样本仓库库存较上周期降0.71万吨, 环比降1.11%。 3、隆众资讯: 7月26日至8月1日, 中国聚乙烯下游制品平均开工率较前期-0.09%。	
		更多资讯请关注!

观点总结	L2409合约冲高回落, 尾盘收于8216元/吨。供应端, 上周重启产能大于新增停车产能, 产能利用率环比+3.02%至78.91%、产量环比+3.58%至51.45万吨。需求端, 上周农膜开工率+1.24%, 包装膜、管材、注塑等开工率小幅波动, 总体来看PE下游平均开工率环比-0.09%。库存方面, 截至7月31日, 中国聚乙烯生产企业库存-3.94%至42.92万吨, 社会库存+0.40%至62.57万吨, 总库存-1.41%至105.49万吨。库存向下传导顺畅, 总库存压力不大。成本端, 油制成本在8858元/吨附近, 煤制成本在7134元/吨附近。本周浙江石化40万吨等装置停车检修, 宁夏宝丰40万吨等装置重启, 预计产量、产能利用率小幅波动、变化不大; LLDPE主要下游农膜开工开始复苏, 需求存上升预期; 库存预计小幅去化, 库存压力不大; 宏观预期偏弱, 文华工业品指数走弱; 预计L2409合约在8150-8350区间波动。	
		更多观点请咨询!

数据来源第三方, 观点仅供参考。市场有风险, 投资需谨慎!

研究员: 黄青青 期货从业资格号F3004212 期货投资咨询从业证书号Z0012250
助理研究员: 徐天泽 期货从业资格号F03133092

免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料, 瑞达期货股份有限公司力求准确可靠, 但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证, 据此投资, 责任自负。本报告不构成个人投资建议, 客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有, 未经书面许可, 任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发, 需注明出处为瑞达期货股份有限公司研究院, 且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。