



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	日胶主力合约收盘价(日, 日元/公斤)	234.00	+0.40↑	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤)	175.60	+1.40↑
	沪胶主力合约收盘价(日, 元/吨)	14,820.00	0.00	20号胶主力合约收盘价(日, 元/吨)	11,625.00	+50.00↑
	沪胶5-9价差(日, 元/吨)	-180	-15.00↓	20号胶3-4价差(日, 元/吨)	-70	-10.00↓
	沪胶与20号胶价差(日, 元/吨)	3,195	-50.00↓			
	沪胶主力合约持仓量(日, 手)	230,971.00	-464.00↓	20号胶主力合约持仓量(日, 手)	26,283.00	-1873.00↓
	沪胶前20名净持仓	-55,426	+2487.00↑	20号胶前20名净持仓	-749	+182.00↑
	沪胶交易所仓单(日, 吨)	208,410.00	+300.00↑	20号胶交易所仓单(日, 吨)	58616	+1412.00↑
现货市场	上海市场国营全乳胶(日, 元/吨)	13850	+25.00↑	上海市场越南3L(日, 元/吨)	13,200.00	0.00
	泰标STR20(日, 美元/吨)	1820	+10.00↑	马标SMR20(日, 美元/吨)	1,800.00	+10.00↑
	泰国人民币混合胶(日, 元/吨)	12850	+20.00↑	马来西亚人民币混合胶(日, 元/吨)	12,850.00	+20.00↑
	齐鲁石化丁苯1502(日, 元/吨)	12,100.00	0.00	齐鲁石化顺丁BR9000(日, 元/吨)	14,300.00	0.00
	沪胶主力合约标准品基差(日, 元/吨)	-970	+25.00↑	沪胶主力合约非标准品基差(日, 元/吨)	-1,770.00	0.00
	20号胶主力合约基差(日, 元/吨)	-233.91	+33.89↑			
上游情况	泰国合艾烟片(日, 泰铢/公斤)	56.65	-0.15↓	泰国合艾生胶片(日, 泰铢/公斤)	53.88	+0.66↑
	泰国合艾胶水(日, 泰铢/公斤)	48.00	0.00	泰国合艾杯胶(日, 泰铢/公斤)	45.80	+0.10↑
	海南全乳原料(日, 元/吨)	12,100.00	0.00	云南胶水(日, 元/公斤)	停割	—
	海南乳胶原料(日, 元/吨)	12,800.00	0.00	云南胶块(日, 元/公斤)	11.00	0.00
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日, 美元/吨)	73.47	+3.76↑	泰国标胶加工利润(日, 美元/吨)	176.89	+5.03↑
	标胶月度进口量(11月, 万吨, %)	24.38	+19.46↑	混合胶月度进口量(11月, 万吨, %)	29.45	+41.29↑
	标胶进口利润(日, 元/吨)	-2,254.29	+11.86↑	青岛地区天胶保税和一般贸易库存(周,万吨,%)	30.4	-4.30↓
	全钢胎开工率(周, %)	64.06	-0.40↓	半钢胎开工率(周, %)	65.35	-0.24↓
期权市场	重卡销量(11月, 万辆, %)	5.00	-6.50↓			
	标的历史20日波动率(日, %)	18.96	-3.14↓	标的历史40日波动率(日, %)	26.05	-3.00↓
	平值看涨期权隐含波动率(日)	0.27	-0.06↓	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	0.2725	-0.02↓
行业消息	<p>产区天气: 泰国南部未来一周降雨明显减少, 对割胶工作影响较小。</p> <p>1、据ANRPC近日发布的《橡胶市场情报报告》预计, 由于春节前需求, 中国在2022年1月前的橡胶进口量将会增加。由于主要生产国橡胶树每年都要越冬, 出现季节性供应短缺, 同时中国制造企业预计在农历春节为期一周的假期前囤积天然橡胶库存。</p> <p>2、据外媒12月28日报道, 由于生产率极低的老旧种植园的占比不断上升, 印度天然橡胶生产的最大潜力在未来几年将会下降。假设目前新植和再植的趋势保持不变, 最大的潜在产量, 目前约为98万吨/年, 将在2030年下降到88.9万吨, 在2040年仅为34.9万吨。</p>					 <p>更多资讯请关注!</p>
观点总结	<p>目前国内云南产区处于停割期,海南产区也陆续停割, 近期泰国南部降雨水平维持低位, 产量有增加预期。由于东南亚运费飙升进口受阻, 入库量仍未恢复至正常水平, 而胶价下跌刺激下游采购积极性, 青岛地区库存持续去库。上周国内轮胎厂开工率环比小幅下降, 检修厂家开工恢复提振, 但在成品库存压力下, 叠加轮胎工厂外贸订单缩减, 内销终端替换步入尾声, 厂家排产谨慎, 短期开工率预计难以明显提升。盘面上, ru2205合约小幅收涨, 短线关注14830附近压力, 若成功突破则有望看向14970一线, 建议暂以观望为主。</p>					 <p>更多观点请咨询!</p>
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 cy: 20号胶