

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)	198.80	+0.30↑	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤)	163.00	+1.20↑
	沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)	12,885.00	-45.00↓	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	11,210.00	-60.00↓
	沪胶9-1价差(日,元/吨)	-1,090	-5.00↓	20号胶9-10价差(日,元/吨)	10	-5.00↓
	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	1,675	+15.00↑			
	沪胶主力合约持仓量(日,手)	203,454.00	-4877.00↓	20号胶主力合约持仓量(日,手)	45,230.00	-92.00↓
	沪胶前20名净持仓	-57,894	+516.00↑	20号胶前20名净持仓	-1,093	+125.00↑
	沪胶交易所仓单(日,吨)	253,080.00	-130.00↓	20号胶交易所仓单(日,吨)	72950	0.00
现货市场	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	12800	+50.00↑	上海市场越南3L(日,元/吨)	12,700.00	-50.00↓
	泰标STR20(日,美元/吨)	1685	0.00	马标SMR20(日,美元/吨)	1,650.00	0.00
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	12600	0.00	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	12,550.00	0.00
	齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)	12,700.00	0.00	齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)	14,700.00	0.00
	沪胶主力合约标准品基差(日,元/吨)	-85.00	+95.00↑	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	-285.00	+45.00↑
	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	8	-97↓			
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	62.00	-0.01↓	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	61.19	0.00
	泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)	52.80	-1.00↓	泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)	47.90	+0.20↑
	海南全乳原料(日,元/吨)	11,500.00	0.00	云南胶水进干胶厂(日,元/公斤)	11.70	0.00
	海南乳胶原料(日,元/吨)	13,700.00	0.00	云南胶水进乳胶厂(日,元/公斤)	12.00	0.00
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	114.60	+2.02↑	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	92.47	-9.71↓
	标胶月度进口量(5月,吨,%)	144,809.47	-0.31↓	混合胶月度进口量(5月,吨,%)	187719.36	+6.59↑
	标胶进口利润(日,美元/吨)	-20.00	0.00	青岛地区天胶保税和一般贸易库存(周,万吨,%)	36.65	-0.14↓
	全钢胎开工率(周,%)	59.11	+0.14↑	半钢胎开工率(周,%)	63.6	-1.11↓
期权市场	重卡销量(5月,万辆,%)	4.70	+7.00↑			
	标的历史20日波动率(日,%)	23.10	+1.21↑	标的历史40日波动率(日,%)	22.10	-0.80↓
	平值看涨期权隐含波动率(日)	19.10	-0.35↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	19.7	+0.20↑

行业消息

未来第一周(2022年6月26日-7月2日)天然橡胶主产区东南亚整体降雨量减少。其中印尼部分地区降雨量仍处于高位状态;越南全境降雨量较上周稍有增加,泰国降雨量变化不大,均处于中低位状态;马来西亚降雨量有所减少,对割胶工作仍存在一定影响。

1、据隆众资讯统计,截至2022年06月26日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量36.65万吨,较上期缩减0.05万吨,环比下跌0.14%,降速去化,依旧处于增减僵持当中,暂未出现明确方向性,同比缩减15.05万吨,跌幅29.11%。

2、据国家统计局最新公布的数据显示,2022年5月中国橡胶轮胎外胎产量为7023.3万条,同比下降10%。1-5月橡胶轮胎外胎产量较上年同期降9.3%至3.40873亿条。



更多资讯请关注!

观点总结

国内外主产区陆续开割,泰国原料逐步上量。国内云南版纳部分地区降雨,原料产出较少;海南产区大部分区域已进入开割,全岛加工厂基本上也正常开工,目前原料胶水产量较前期出现明显好转,但部分地区橡胶树依旧处于新叶生长阶段,整体上量预计在七月中旬左右。近期青岛天然橡胶库存小幅缩减,依旧处于增减僵持当中,考虑到进口陆续增加,入库量环比增加的可能,预计短期青岛地区库存降速消库甚至小幅累库。需求方面,上周轮胎厂开工率环比变动不大,多数企业开工趋稳,但当前销售压力较大,企业成品库存高位,预计整体提升幅度有限。盘面上,ru2209合约小幅收涨,期价承压于12950附近压力,短期建议在12700-12950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