

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)	173.9	10.3↑	沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)	13220	-125↓
	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	10230	-30↓	沪胶5-9价差(日,元/吨)	120	-75↓
	20号胶4-5价差(日,元/吨)	-45	0	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	2990	-95↓
	沪胶主力合约持仓量(日,手)	203298	5815↑	20号胶主力合约持仓量(日,手)	33909	-7168↓
	沪胶前20名净持仓	-60685	-2964↓	20号胶前20名净持仓	-8797	-266↓
现货市场	沪胶交易所仓单(日,吨)	183360	0	20号胶交易所仓单(日,吨)	27498	0
	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	12825	0	上海市场越南3L(日,元/吨)	12100	250↑
	泰标STR20(日,美元/吨)	1510	0	马标SMR20(日,美元/吨)	1500	0
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	11220	-180↓	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	11180	-170↓
	齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)	11700	0	齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)	10900	0
上游情况	沪胶主力合约标准品基差(日,元/吨)	-520	10↑	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	-2125	18↑
	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	-49	172↑			
	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	53	4.4↑	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	49	-4.53↓
	泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)	52	0.5↑	泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)	40.5	-0.25↓
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	-3.09	-44.65↓	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	21.51	-32.64↓
	技术分类天然橡胶月度进口量(万吨)	12.8	2.73↑	混合胶月度进口量(万吨)	38.4	5.52↑
	标胶进口利润(日,美元/吨)	-30	0			
期权市场	全钢胎开工率(周,%)	17.64	-19.32↓	半钢胎开工率(周,%)	23.82	-18.82↓
	重卡销量(辆,%)	54000	9000↑			
行业消息	标的历历史20日波动率(日,%)	17.22	0.53↑	标的历历史40日波动率(日,%)	8.48	0.27↑
	平值看涨期权隐含波动率(日)	23.34	-0.08↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	23.39	-0.31↓
	未来第一周(2023年1月29日-2月4日)天然橡胶东南亚主产区降雨量较上一周期小幅减少,其中红色高位预警区域主要分布在菲律宾东部地区,其他区域降水处于中偏低状态,对割胶工作影响持小幅减少预期,赤道以南红色高位预警区位于印度尼西亚零星区域,其他区域降雨量处于中偏高状态,对割胶工作增强预期。					
	1、据隆众资讯统计,截至2023年1月29日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量54.2万吨,较上期增加4万吨,环比增幅8.09%。保税区库存环比增加13.44%至10万吨,一般贸易库存环比增加6.94%至44.2万吨,青岛天然橡胶样本保税仓库入库率下降0.29个百分点;出库率下降2.94个百分点;一般贸易仓库入库率下降1.41个百分点,出库率下降3.02个百分点。					
	2、海关数据显示,2022年12月中国天然橡胶(含技术分类、胶乳、烟胶片、初级形状、混合胶、复合胶)进口量终值66.50万吨,环比增加7.94%,同比增加30.64%,1-12月份累计进口606.13万吨,累计同比上涨12.78%。					
观点总结	目前全球供应逐渐收缩,泰国南部产区向季节性低产季过渡,未来原料产出缩量趋势性明确,泰国合艾胶水收购价格上涨,成本端支撑明显;越南产区春节后进入停割期,雨水相对偏多。近期进口货源有所增加,青岛一般贸易库存量继续累库为主,保税累库幅度依然较高。需求方面,节后各轮胎企业按计划复工复产并陆续安排发货,复工状态比往年更为积极,短期轮胎企业产能利用率快速恢复,将拉动1月底至2月份原材料需求。ru2305合约短线关注13200附近支撑,可关注轻仓逢低买入机会,注意风险控制。					
提示关注	周四隆众轮胎样本企业开工率					

数据来源于第三方,仅供参考。市场有风险,投资需谨慎!



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!