

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)  | 169.50     | +0.40↑    | 新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤) | 149.10    | -0.60↓    |
|      | 沪胶主力合约收盘价 (日, 元/吨)   | 11,960.00  | -110.00↓  | 20号胶主力合约收盘价 (日, 元/吨)     | 10,375.00 | -70.00↓   |
|      | 沪胶9-1价差 (日, 元/吨)   | -875       | +90.00↑   | 20号胶10-11价差 (日, 元/吨)     | 60        | +15.00↑   |
|      | 沪胶与20号胶价差 (日, 元/吨)   | 1,585      | -40.00↓   | 20号胶主力合约持仓量 (日, 手)       | 51,368.00 | +1872.00↑ |
|      | 沪胶主力合约 持仓量 (日, 手)  | 93,313.00  | -2590.00↓ | 20号胶前20名净持仓              | -1,833    | -33.00↓   |
|      | 沪胶前20名净持仓  | -42,769    | -2101.00↓ | 20号胶交易所仓单 (日, 吨)         | 66347     | -403.00↓  |
| 现货市场 | 沪胶交易所仓单 (日, 吨)   | 255,880.00 | +1040.00↑ |                          |           |           |
|      | 上海市场国营全乳胶 (日, 元/吨)   | 12150      | 0.00      | 上海市场越南3L (日, 元/吨)        | 12,150.00 | -50.00↓   |
|      | 泰标STR20 (日, 美元/吨)  | 1580       | -20.00↓   | 马标SMR20 (日, 美元/吨)        | 1,560.00  | -20.00↓   |
|      | 泰国人民币混合胶 (日, 元/吨)  | 11800      | -100.00↓  | 马来西亚人民币混合胶 (日, 元/吨)      | 11,750.00 | -100.00↓  |
|      | 齐鲁石化丁苯1502 (日, 元/吨)  | 12,000.00  | -200.00↓  | 齐鲁石化顺丁BR9000 (日, 元/吨)    | 13,100.00 | -400.00↓  |
|      | 沪胶主力合约标准品基差 (日, 元/吨)   | 190.00     | +110.00↑  | 沪胶主力合约非标准品基差 (日, 元/吨)    | -160.00   | +10.00↑   |
| 上游情况 | 20号胶主力合约基差 (日, 元/吨)  | 405        | +141↑     |                          |           |           |
|      | 泰国合艾烟片 (日, 泰铢/公斤)  | 56.00      | 0.00      | 泰国合艾生胶片 (日, 泰铢/公斤)       | 53.97     | -0.71↓    |
|      | 泰国合艾胶水 (日, 泰铢/公斤)  | 51.70      | 0.00      | 泰国合艾杯胶 (日, 泰铢/公斤)        | 47.15     | +0.35↑    |
|      | 海南全乳原料 (日, 元/吨)  | 10,800.00  | -100.00↓  | 云南胶水进干胶厂 (日, 元/公斤)       | 11.00     | 0.00      |
| 下游情况 | 海南乳胶原料 (日, 元/吨)  | 12,200.00  | +100.00↑  | 云南胶水进乳胶厂 (日, 元/公斤)       | 11.30     | -0.10↓    |
|      | 泰国3号烟片加工利润 (日, 美元/吨)   | 116.20     | -3.23↓    | 泰国标胶加工利润 (日, 美元/吨)       | 47.70     | +1.10↑    |
|      | 标胶月度进口量 (吨, %)   | 168,189.18 | +0.16↑    | 混合胶月度进口量 (吨, %)          | 260176.30 | +39.78↑   |
| 期权市场 | 标胶进口利润 (日, 美元/吨)   | 10.00      | +10.00↑   |                          |           |           |
|      | 全钢胎开工率 (周, %)  | 58.67      | +3.11↑    | 半钢胎开工率 (周, %)            | 64.2      | -0.57↓    |
|      | 重卡销量 (7月, 万辆, %)   | 4.90       | -11.00↓   |                          |           |           |
| 行业消息 | 标的历20日波动率 (日, %)   | 26.50      | +0.90↑    | 标的历40日波动率 (日, %)         | 11.50     | -1.10↓    |
|      | 平值看涨期权隐含波动率 (日)  | 19.50      | +0.59↑    | 平值看跌期权隐含波动率 (日, %)       | 18.89     | -0.34↓    |
| 观点总结 | 未来第一周（2022年7月31日-8月6日）天然橡胶东南亚主产区整体降雨量较上一周期明显增加，其中泰国少数区域、柬埔寨大部分区域处于红色高位降雨预警状态，泰国东北部、老挝、柬埔寨、越南等区域降雨量基本上增加中偏高状态，进一步影响割胶工作的开展，马来西亚、印度尼西亚区域红色高位预警区域缩小，但降雨量依旧处于中偏高状态，整体影响进一步走强。  |            |           |                          |           |           |
|      | 1、8月1日消息，中国汽车流通协会发布的最新一期“中国汽车经销商库存预警指数调查”VIA (Vehicle Inventory Alert Index)显示，2022年7月中国汽车经销商库存预警指数为54.4%，同比上升2.1个百分点，环比上升4.9个百分点，库存预警指数位于荣枯线之上。<br>2、据隆众资讯统计，截至2022年07月31日，青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量37.29万吨，较上期增加0.2万吨，环比上涨  |            |           |                          |           |           |
| 提示关注 | 国内外主产区处于割胶期，东南亚主产区整体降雨量有所增加，对割胶工作影响进一步加大。国内云南版纳降雨增加，原料产出偏少，收购价格持稳；海南进入全面开割状态，胶水存上量预期。近期青岛天然橡胶库存小幅增加，依旧未出现明显去库或者累库方向，考虑到近期价格小幅回落刺激下游拿货积极性，短期库存存在小幅去库可能。需求方面，上周轮胎厂开工率环比继续下降，在成品库存高位压力下，部分存停产或降负安排，拖曳整体开工率下滑，随着前期检修装置逐步恢复，短期开工率或小幅波动。盘面上，ru2301合约增仓收跌，短期关注12650附近支撑，建议在12650-13000区间交易。 |            |           |                          |           |           |
|      |  |            |           |                          |           |           |

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



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!