

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)	176.60	+7.80↑	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤)	151.80	+0.60↑
	沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)	11,940.00	-25.00↓	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	10,770.00	+75.00↑
	沪胶9-1价差(日,元/吨)	-1,110	+35.00↑	20号胶9-10价差(日,元/吨)	185	+30.00↑
	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	1,170	-100.00↓			
	沪胶主力合约持仓量(日,手)	163,649.00	-2832.00↓	20号胶主力合约持仓量(日,手)	52,592.00	+328.00↑
	沪胶前20名净持仓	-39,715	+3042.00↑	20号胶前20名净持仓	-4,526	-926.00↓
	沪胶交易所仓单(日,吨)	257,620.00	-1120.00↓	20号胶交易所仓单(日,吨)	65288	+202.00↑
现货市场	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	12050	+50.00↑	上海市场越南3L(日,元/吨)	12,250.00	0.00
	泰标STR20(日,美元/吨)	1585	0.00	马标SMR20(日,美元/吨)	1,560.00	0.00
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	12000	0.00	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	11,950.00	0.00
	齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)	12,000.00	0.00	齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)	13,300.00	0.00
	沪胶主力合约标准品基差(日,元/吨)	110.00	+75.00↑	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	60.00	+25.00↑
	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	-5	-243↓			
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	58.06	-1.09↓	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	56.70	-0.77↓
	泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)	52.30	-0.70↓	泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)	47.40	+0.40↑
	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)	10.90	0.00
	海南乳胶原料(日,元/吨)	12,100.00	0.00	云南胶水进乳胶厂(日,元/公斤)	11.20	+0.10↑
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	135.26	+31.48↑	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	86.11	+33.29↑
	标胶月度进口量(吨,%)	144,809.47	-0.31↓	混合胶月度进口量(吨,%)	187719.36	+6.59↑
	标胶进口利润(日,美元/吨)	-30.00	+10.00↑	青岛地区天胶保税和一般贸易库存(周,万吨,%)	37.77	+2.27↑
	全钢胎开工率(周,%)	59.29	+1.64↑	半钢胎开工率(周,%)	65	+1.57↑
	重卡销量(6月,万辆,%)	5.30	+8.00↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	23.82	-0.13↓	标的历史40日波动率(日,%)	11.30	0.00
	平值看涨期权隐含波动率(日)	23.82	-0.48↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	21.62	-0.40↓
行业消息	未来第一周(2022年7月17日-7月23日)天然橡胶东南亚主产区降雨明显减少。其中柬埔寨、老挝、越南红色预警区域减少,相对缓和高位降雨带来的影响。目前中偏高位降雨主要集中在泰国、柬埔寨、老挝,要谨防持续性降雨对割胶工作带来的影响。 1、据隆众资讯统计,截至2022年07月10日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量37.77万吨,较上期增加0.84万吨,环比上涨2.27%,依旧处于僵持状态,同比缩减12.59万吨,跌幅25%。海外天胶产量提升,分流中国数量增加,预计本周青岛地区天胶现货库存存在增加可能。 2、QinRex据中国海关总署7月13日公布的数据显示,2022年6月中国进口天然及合成橡胶(含胶乳)合计53.6万吨,较2021年同期的46.2万吨增加16%。2022年1-6月中国进口天然及合成橡胶(含胶乳)共计339.6万吨,较2021年同期的329.4万吨增长3.1%					 更多资讯请关注!
观点总结	国内外主产区处于割胶期,泰国原料上量较快。国内云南版纳降雨较多,对割胶工作造成一定影响,但胶水分流减淡,全乳胶产量增加;海南目前割胶情况转好,基本上已陆续进入全面开割状态,胶水上量预期偏强,但浓乳成品成交不及预期,部分加工厂表示近期收胶意愿走低。近期青岛天然橡胶库存小幅增加,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有继续小幅累库的可能。需求方面,上周轮胎厂开工率环比小幅提升,但在成品库存高位压力下,短期仍存停产或降负安排。盘面上,ru2209合约小幅收涨,短线关注12100附近压力,建议在11700-12100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