

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)	166.50	-1.10↓	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤)	149.80	+0.90↑
	沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)	13,255.00	+285.00↑	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	10,675.00	+205.00↑
	沪胶9-1价差(日,元/吨)	-1,000	-110.00↓	20号胶10-11价差(日,元/吨)	75	+10.00↑
	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	2,580	+80.00↑			
	沪胶主力合约持仓量(日,手)	116,431.00	+5479.00↑	20号胶主力合约持仓量(日,手)	48,855.00	-2094.00↓
	沪胶前20名净持仓	-42,333	+1089.00↑	20号胶前20名净持仓	-3,075	-495.00↓
	沪胶交易所仓单(日,吨)	255,320.00	-170.00↓	20号胶交易所仓单(日,吨)	66749	+604.00↑
现货市场	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	12300	+200.00↑	上海市场越南3L(日,元/吨)	12,250.00	+150.00↑
	泰标STR20(日,美元/吨)	1590	+10.00↑	马标SMR20(日,美元/吨)	1,580.00	+20.00↑
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	12000	+100.00↑	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	11,900.00	+50.00↑
	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)	13,100.00	0.00
	沪胶主力合约标准品基差(日,元/吨)	-955.00	-85.00↓	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	-1,255.00	-185.00↓
	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	247	-64↓			
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	54.89	-0.68↓	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	53.58	0.00
	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)	47.05	+0.15↑
	海南全乳原料(日,元/吨)	10,900.00	+300.00↑	云南胶水进干胶厂(日,元/公斤)	11.00	+0.10↑
	海南乳胶原料(日,元/吨)	12,000.00	-200.00↓	云南胶水进乳胶厂(日,元/公斤)	11.40	+0.20↑
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	56.14	-3.46↓	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	13.62	-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↑
	标胶进口利润(日,美元/吨)	0.00	-10.00↓			
	全钢胎开工率(周,%)	56.72	-1.95↓	半钢胎开工率(周,%)	64.01	-0.19↓
期权市场	重卡销量(7月,万辆,%)	4.90	-11.00↓			
	标的历史20日波动率(日,%)	26.43	+0.68↑	标的历史40日波动率(日,%)	12.09	-0.70↓
	平值看涨期权隐含波动率(日)	19.22	+0.45↑	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	19.21	+0.88↑
行业消息	未来第一周(2022年8月7日-8月13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,其中泰国泰国东北部少数区域、柬埔寨大部分区域处于红色高位降雨预警状态,泰国老挝、柬埔寨、越南等区域降雨量基本上增加中偏高状态,对割胶工作影响明显,马来西亚、印度尼西亚区域红色高位预警区域缩小,降雨量也下滑至中偏低状态,整体影响减弱。 1、据中国海关总署8月7日公布的数据显示,2022年7月中国进口天然及合成橡胶(含胶乳)合计58万吨,较2021年同期的52.5万吨增加10.5%。1-7月中国进口天然及合成橡胶(含胶乳)共计397.5万吨,较2021年同期的381.9万吨增加4.1%。 2、QinRex最新数据显示,2022年前7个月,科特迪瓦橡胶出口量共计711,257吨,较2021年同期的600,104吨增加18.5%。					
观点总结	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,影响割胶工作的开展,新鲜胶水量偏低;海南原料胶水制浓乳与制全乳胶价差收窄,利于全乳胶平稳提量。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小幅下降,在成品库存高位压力下,恰逢夏季高温,安排常规检修或适度降负,拖累整体开工率下滑,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合约增仓收涨,短期关注期价能否站稳13250一线,若站稳则有望进一步向上挑战13500一线,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!