

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)	194.70	+5.00↑	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤)	163.80	+1.00↑
	沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)	12,655.00	-245.00↓	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	10,990.00	-225.00↓
	沪胶9-1价差(日,元/吨)	-1,075	-5.00↓	20号胶9-10价差(日,元/吨)	25	-15.00↓
	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	1,665	-20.00↓			
	沪胶主力合约持仓量(日,手)	189,964.00	-7195.00↓	20号胶主力合约持仓量(日,手)	50,148.00	+751.00↑
	沪胶前20名净持仓	-55,525	+3803.00↑	20号胶前20名净持仓	-2,226	+317.00↑
	沪胶交易所仓单(日,吨)	252,900.00	-120.00↓	20号胶交易所仓单(日,吨)	67607	-1209.00↓
现货市场	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	12850	-100.00↓	上海市场越南3L(日,元/吨)	12,750.00	-150.00↓
	泰标STR20(日,美元/吨)	1695	-5.00↓	马标SMR20(日,美元/吨)	1,655.00	-10.00↓
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	12600	-100.00↓	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	12,550.00	-100.00↓
	齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)	12,400.00	0.00	齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)	14,200.00	0.00
	沪胶主力合约标准品基差(日,元/吨)	195.00	+145.00↑	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	-55.00	+145.00↑
	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	139	+82↑			
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	61.09	-1.00↓	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	58.60	-0.10↓
	泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)	52.80	0.00	泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)	47.80	-0.60↓
	海南全乳原料(日,元/吨)	11,300.00	-200.00↓	云南胶水进干胶厂(日,元/公斤)	11.50	-0.30↓
	海南乳胶原料(日,元/吨)	13,200.00	-300.00↓	云南胶水进乳胶厂(日,元/公斤)	12.20	0.00
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	167.69	+28.52↑	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	114.07	+11.63↑
	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)	-10.00	+5.00↑	青岛地区天胶保税和一般贸易库存(周,万吨,%)	36.93	+0.76↑
	全钢胎开工率(周,%)	58.80	-0.31↓	半钢胎开工率(周,%)	64.6	+1.00↑
	重卡销量(5月,万辆,%)	4.70	+7.00↑			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	23.20	+1.10↑	标的历史40日波动率(日,%)	23.02	-0.31↓
	平值看涨期权隐含波动率(日)	18.10	-0.40↓	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	19.9	+0.10↑
行业消息	未来第一周(2022年7月3日-7月9日)天然橡胶东南亚主产区降雨增加明显。其中泰国西部降雨量明显增加至高位红色预警状态,泰国大部分区域降雨量均处于中偏高状态,对割胶工作的影响增加。柬埔寨、老挝、越南产区部分区域降雨量也增加至中高位状态,对割胶工作的影响增强。 1、据隆众资讯统计,截至2022年07月03日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量36.93万吨,较上期增加0.28万吨,环比上涨0.76%,依旧处于增减僵持当中,暂未出现明确方向性,同比缩减14.58万吨,跌幅28.3%。 2、2022年前五个月,泰国出口天然橡胶(不含复合橡胶)合计为143.2万吨,同比增3%。其中,标胶合计出口71.2万吨,同比增10%;烟片胶出口20.3万吨,同比增4%;乳胶出口48.9万吨,同比则降8%。					
观点总结	国内外主产区陆续开割,泰国原料逐步上量。国内云南版纳近两日降雨较多,对割胶工作开展的影响明显,新鲜胶水产量较低;海南目前全岛开割情况陆续好转,预计七月中旬陆续进入全面开割状态,目前处于原料上量阶段,而浓乳成品价格成交不易,拖拽加工厂收胶积极性。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,上周轮胎厂开工率小幅下降,据悉部分企业安排检修,由于终端需求恢复缓慢,轮胎企业成品库存维持高位,预计短期开工率仍存走低预期。受国际油价跌势影响,ru2209合约减仓下行,短期关注12500附近支撑,建议在12500-12850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!