



撰写人:林静宣 从业资格证号:F0309984 投资咨询从业证书号:Z0013465

天然橡胶产业日报

2022-08-10

| 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) | 167 | 0.5↑ | 新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分) | 151.8 | 2↑ |
| | 沪胶主力合约收盘价 (日, 元/吨) | 12920 | -300↓ | 20号胶主力合约收盘价 (日, 元/吨) | 10420 | -225↓ |
| | 沪胶9-1价差 (日, 元/吨) | -915 | 80↑ | 20号胶10-11价差 (日, 元/吨) | 125 | -10↓ |
| | 沪胶与20号胶价差 (日, 元/吨) | 2500 | 920↑ | 沪胶主力合约 持仓量 (日, 手) | 130925 | 54035↑ |
| | 20号胶主力合约持仓量 (日, 手) | 49486 | 847↑ | 沪胶前20名净持仓 | -42817 | -1326↓ |
| | 20号胶前20名净持仓 | -2657 | 384↑ | 沪胶交易所仓单 (日, 吨) | 255370 | 210↑ |
| | 20号胶交易所仓单 (日, 吨) | 67757 | 202↑ | | | |
| 现货市场 | 上海市场国营全乳胶 (日, 元/吨) | 12100 | -200↓ | 上海市场越南3L (日, 元/吨) | 12050 | -200↓ |
| | 泰标STR20 (日, 美元/吨) | 1575 | -5↓ | 马标SMR20 (日, 美元/吨) | 1565 | -5↓ |
| | 泰国人民币混合胶 (日, 元/吨) | 11850 | -50↓ | 马来西亚人民币混合胶 (日, 元/吨) | 11800 | -50↓ |
| | 齐鲁石化丁苯1502 (日, 元/吨) | 11700 | 0 | 齐鲁石化顺丁BR9000 (日, 元/吨) | 12600 | 0 |
| | 沪胶主力合约标准品基差 (日, 元/吨) | -820 | -895↓ | 沪胶主力合约非标准品基差 (日, 元/吨) | -1070 | 250↑ |
| | 20号胶主力合约基差 (日, 元/吨) | 168 | 12↑ | | | |
| 上游情况 | 泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤) | 53.25 | -0.75↓ | 泰国合艾生胶片 (日, 泰铢/公斤) | 51.88 | -0.7↓ |
| | 泰国合艾胶水 (日, 泰铢/公斤) | 50.5 | -0.5↓ | 泰国合艾杯胶 (日, 泰铢/公斤) | 46.8 | -0.4↓ |
| | 云南产区原料(日,元/吨) | 11600 | 100↑ | 海南产区原料(日,元/吨) | 12000 | 0 |
| | 泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨) | 92.66 | 11.93↑ | 泰国标胶加工利润(日,美元/吨) | 14.44 | -18.82↓ |
| | 技术分类天然橡胶月度进口量 (万吨) | 9.99 | 1↑ | 混合胶月度进口量 (万吨) | 26.02 | 7.25↑ |
| | 标胶进口利润 (日, 美元/吨) | -20 | -20↓ | | | |
| 下游情况 | 全钢胎开工率 (周, %) | 56.72 | -1.95↓ | 半钢胎开工率 (周, %) | 64.01 | -0.19↓ |
| | 重卡销量 (辆, %) | 49000 | -4000↓ | | | |
| 期权市场 | 标的历20日波动率 (日, %) | 29.62 | 3.25↑ | 标的历40日波动率 (日, %) | 11.22 | -0.09↓ |
| | 平值看涨期权隐含波动率 (日) | 21.15 | 2.99↑ | 平值看跌期权隐含波动率 (日, %) | 20.03 | 3.16↑ |
| 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, 新鲜胶水产量偏低; 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增加, 涨幅环比小幅扩大, 8月份进口量有增加预期, 而下游工厂维持刚需拿货节奏, 短期库存或维持小幅累库。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12650-13100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!