

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	日胶主力合约收盘价(日, 日元/公斤)	233.60	+4.70↑	新加坡TSR20主力结算价(日,美分/公斤)	171.70	-0.90↓
	沪胶主力合约收盘价(日, 元/吨)	14,210.00	-395.00↓	20号胶主力合约收盘价(日, 元/吨)	11,010.00	-230.00↓
	沪胶1-5价差(日, 元/吨)	-220	+15.00↑	20号胶2-3价差(日, 元/吨)	-55	+30.00↑
	沪胶与20号胶价差(日, 元/吨)	3,200	-165.00↓			
	沪胶主力合约 持仓量(日, 手)	237,407	+19230↑	20号胶主力合约持仓量(日, 手)	15,657	-2361↓
	沪胶前20名净持仓	-61126	-2439↓	20号胶前20名净持仓	513	+551↑
	沪胶交易所仓单(日, 吨)	195,930	+3700↑	20号胶交易所仓单(日, 吨)	53888	+605↑
现货市场	上海市场国营全乳胶(日, 元/吨)	13300	-375.00↓	上海市场越南3L(日, 元/吨)	12,950.00	-250.00↓
	泰标STR20(日, 美元/吨)	1800	0.00	马标SMR20(日, 美元/吨)	1,790.00	0.00
	泰国人民币混合胶(日, 元/吨)	12750	-150.00↓	马来西亚人民币混合胶(日, 元/吨)	12,700.00	-150.00↓
	齐鲁石化丁苯1502(日, 元/吨)	12,300.00	0.00	齐鲁石化顺丁BR9000(日, 元/吨)	14,600.00	0.00
	沪胶主力合约标准品基差(日, 元/吨)	-910	+20.00↑	沪胶主力合约非标准品基差(日, 元/吨)	-1,460.00	+195.00↑
	20号胶主力合约基差(日, 元/吨)	42.33	+122.47↑			
上游情况	泰国合艾烟片(日, 泰铢/公斤)	59.89	+1.11↑	泰国合艾生胶片(日, 泰铢/公斤)	54.52	+4.02↑
	泰国合艾胶水(日, 泰铢/公斤)	51.20	-1.30↓	泰国合艾杯胶(日, 泰铢/公斤)	47.05	-0.69↓
	海南全乳原料(日, 元/吨)	12,800.00	0.00	云南胶水(日, 元/公斤)	停割	——
	海南乳胶原料(日, 元/吨)	13,000.00	0.00	云南胶块(日, 元/公斤)	11.20	0.00
下游情况	泰国3号烟片加工利润(日, 美元/吨)	4.60	+1.01↑	泰国标胶加工利润(日, 美元/吨)	87	-1.38↓
	标胶月度进口量(10月, 万吨, %)	20.40	-16.77↓	混合胶月度进口量(10月, 万吨, %)	20.84	-18.92↓
	标胶进口利润(日, 元/吨)	-2,210.94	+96.58↑	青岛地区天胶保税和一般贸易库存(周,万吨)	33.15	-5.79↓
	全钢胎开工率(周, %)	64.46	+0.56↑	半钢胎开工率(周, %)	65.59	+1.87↑
	重卡销量(11月, 万辆, %)	5.00	-6.50↓			
期权市场	标的历史20日波动率(日, %)	27.57	-1.27↓	标的历史40日波动率(日, %)	29.99	+0.69↑
	平值看涨期权隐含波动率(日, %)	24.25	+1.15↑	平值看跌期权隐含波动率(日, %)	23.37	+0.32↑
行业消息	产区天气: 未来第一周泰国南部降雨维持相对低位状态, 对原料产出影响较小, 未来第二周, 泰国南部降雨增多, 对割胶工作影响增大。 1.QinRex: 根据欧洲汽车制造商协会(ACEA)最新公布的数据显示, 2021年11月欧盟新车销量同比降20.5%至713,346辆, 这是今年连续第五个月下降, 也是自1993年以来11月份的销量最差记录。大多数欧盟国家遭受两位数的下降, 其中包括四个最大的市场: 德国(-31.7%)、意大利(-24.6%)、西班牙(-12.3%)和法国(-3.2%)。保加利亚、爱尔兰和斯洛文尼亚是仅有的有增长的欧盟市场。 2.QinRex: 据国家统计局最新公布的数据显示, 中国11月橡胶轮胎外胎产量为8042.1万条, 同比下降2.7%。					 更多资讯请关注!
观点总结	目前国内云南产区处于停割期,海南产区也临近停割, 台风“雷伊”对东南亚和海南产区割胶影响有限。由于东南亚运费飙升, 进口量环比难以大幅增加, 青岛地区天然橡胶累库预期持续延后, 但云南替代指标快速进入, 推动云南库存周环比大幅增加。上周国内轮胎厂开工率环比上涨, 检修厂家开工逐步恢复, 带动整体开工略有提升, 冬奥会等政策影响仍存众多不确定性因素, 厂家适度储备库存。但经销商库存高位, 且轮胎工厂外贸订单缩减, 内销终端替换亦逐渐步入尾声, 加上工厂原料库存明显增加, 轮胎厂对天胶采购进程或有减缓。盘面上, ru2205合约增仓放量, 短期关注14200附近支撑, 建议暂以观望为主。					 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!