

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↓   |
| 期权市场 | 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↓   |                         |           |          |
| 行业消息 | 标的历20日波动率(日, %)  | 27.57     | -1.27↓   | 标的历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↑   |
| 观点总结 | 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。<br>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。<br>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%。 |           |          |                         |           |          |
|      | 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。   |           |          |                         |           |          |
| 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!



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!