



撰写人:林静宜 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

2022-08-30

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)	157.7	0.2↑	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分)	141.2	0
	沪胶主力合约收盘价 (日, 元/吨)	12635	-135↓	20号胶主力合约收盘价 (日, 元/吨)	9915	-170↓
	沪胶9-1价差 (日, 元/吨)	-765	80↑	20号胶10-11价差 (日, 元/吨)	-90	15↑
	沪胶与20号胶价差 (日, 元/吨)	2720	115↑	沪胶主力合约持仓量 (日, 手)	170186	2485↑
	20号胶主力合约持仓量 (日, 手)	52235	33512↑	沪胶前20名净持仓	-37220	-539↓
	20号胶前20名净持仓	-1816	-89↓	沪胶交易所仓单 (日, 吨)	260610	-390↓
	20号胶交易所仓单 (日, 吨)	59946	202↑			
现货市场	上海市场国营全乳胶 (日, 元/吨)	11875	-100↓	上海市场越南3L (日, 元/吨)	11800	-100↓
	泰标STR20 (日, 美元/吨)	1485	0	马标SMR20 (日, 美元/吨)	1480	0
	泰国人民币混合胶 (日, 元/吨)	11400	40↑	马来西亚人民币混合胶 (日, 元/吨)	11370	40↑
	齐鲁石化丁苯1502 (日, 元/吨)	11500	0	齐鲁石化顺丁BR9000 (日, 元/吨)	12400	0
	沪胶主力合约标准品基差 (日, 元/吨)	-760	35↑	沪胶主力合约非标准品基差 (日, 元/吨)	-1370	-60↓
	20号胶主力合约基差 (日, 元/吨)	36	-34↓			
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	50.02	-0.08↓	泰国合艾生胶片 (日, 泰铢/公斤)	48	-0.18↓
	泰国合艾胶水 (日, 泰铢/公斤)	48.2	0.2↑	泰国合艾杯胶 (日, 泰铢/公斤)	43.25	-0.25↓
	云南产区原料(日,元/吨)	11500	0	海南产区原料(日,元/吨)	11500	200↑
	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	10.63	-1.48↓	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	66.52	65.28↑
	技术分类天然橡胶月度进口量 (万吨)	9.58	-0.41↓	混合胶月度进口量 (万吨)	28.27	2.25↑
	标胶进口利润 (日, 美元/吨)	0	5↑			
下游情况	全钢胎开工率 (周, %)	58.63	1.82↑	半钢胎开工率 (周, %)	61.66	0.33↑
	重卡销量 (辆, %)	49000	-4000↓			
期权市场	标的历20日波动率 (日, %)	23.89	0.36↑	标的历40日波动率 (日, %)	10.9	0.04↑
	平值看涨期权隐含波动率 (日)	20.75	0.28↑	平值看跌期权隐含波动率 (日, %)	19.47	0.25↑
行业消息	未来第一周(2022年8月28日-9月3日)天然橡胶东南亚主产区整体降雨量较上一周期出现下滑,其中柬埔寨、越南少数区域依旧存在红色高位预警状态,泰国大部分区域降雨量下滑至中偏低状态,降雨量较少,一定程度有利于割胶工作开展,老挝、越南北部区域降雨量也处于中偏低状态,而马来西亚以及印度尼西亚降雨依旧处于高位状态,对割胶工作依旧存在影响。					
	1、据隆众资讯统计,截至2022年08月21日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量38.23万吨,较上期增加0.12万吨,环比上涨0.31%,涨幅较上涨小幅收窄,维持自2月末以来的僵持状态,同比缩减7.98万吨,跌幅17.28%,维持近期同比跌幅不断收窄走势。					
	2、2022年前7个月,泰国出口天然橡胶(不含复合橡胶)合计为198.8万吨,同比增6.6%。其中,标胶合计出口100.5万吨,同比增12.3%;烟片胶出口27.1万吨,同比降3.2%;乳胶出口67.6万吨,同比增2%。					
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减少,对割胶工作的影响减弱。国内云南版纳天气良好,原料产出增加;海南原料胶水制浓乳与制全乳胶价差持稳,原料向全乳胶厂分流。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,由于下游拿货积极性有所降低,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提升,前期检修样本企业开工逐步恢复至常规水平,带动企业开工率的提升,但据悉东营地区部分企业月末存3天左右的短期检修计划,将对整体开工形成一定拖拽。盘面上,ru2301合约增仓收跌,短线关注12830附近压力,建议在12500-12830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!