

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)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 192.40     | +0.50↑    | 新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分/公斤) | 159.40    | +0.60↑                                                                                            |
|      | 沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 12,685.00  | +40.00↑   | 20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)       | 11,100.00 | +80.00↑                                                                                           |
|      | 沪胶9-1价差(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | -1,075     | +15.00↑   | 20号胶9-10价差(日,元/吨)        | 80        | +25.00↑                                                                                           |
|      | 沪胶与20号胶价差(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 1,585      | -40.00↓   |                          |           |                                                                                                   |
|      | 沪胶主力合约持仓量(日,手)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 182,385.00 | -1679.00↓ | 20号胶主力合约持仓量(日,手)         | 50,526.00 | -165.00↓                                                                                          |
|      | 沪胶前20名净持仓                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | -52,253    | +1011.00↑ | 20号胶前20名净持仓              | -4,552    | -886.00↓                                                                                          |
|      | 沪胶交易所仓单(日,吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 253,860.00 | -180.00↓  | 20号胶交易所仓单(日,吨)           | 66256     | 0.00                                                                                              |
| 现货市场 | 上海市场国营全乳胶(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 12700      | +50.00↑   | 上海市场越南3L(日,元/吨)          | 12,650.00 | +50.00↑                                                                                           |
|      | 泰标STR20(日,美元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 1660       | -10.00↓   | 马标SMR20(日,美元/吨)          | 1,635.00  | 0.00                                                                                              |
|      | 泰国人民币混合胶(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 12500      | +50.00↑   | 马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)        | 12,450.00 | +50.00↑                                                                                           |
|      | 齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 12,200.00  | -200.00↓  | 齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)      | 13,900.00 | 0.00                                                                                              |
|      | 沪胶主力合约标准品基差(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 15.00      | +10.00↑   | 沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)      | -185.00   | +10.00↑                                                                                           |
|      | 20号胶主力合约基差(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 95         | -60↓      |                          |           |                                                                                                   |
| 上游情况 | 泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 60.33      | +0.14↑    | 泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)         | 58.58     | -0.30↓                                                                                            |
|      | 泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 53.00      | +0.20↑    | 泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)          | 48.00     | +0.25↑                                                                                            |
|      | 海南全乳原料(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 11,300.00  | 0.00      | 云南胶水进干胶厂(日,元/公斤)         | 11.40     | -0.10↓                                                                                            |
|      | 海南乳胶原料(日,元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 12,800.00  | 0.00      | 云南胶水进乳胶厂(日,元/公斤)         | 11.70     | -0.10↓                                                                                            |
| 下游情况 | 泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 151.77     | +0.11↑    | 泰国标胶加工利润(日,美元/吨)         | 113.92    | +6.19↑                                                                                            |
|      | 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     | 0.00      | 青岛地区天胶保税和一般贸易库存(周,万吨,%)  | 37.77     | +2.27↑                                                                                            |
|      | 全钢胎开工率(周,%)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 57.65      | -1.15↓    | 半钢胎开工率(周,%)              | 63.43     | -1.17↓                                                                                            |
|      | 重卡销量(6月,万辆,%)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 5.30       | +8.00↑    |                          |           |                                                                                                   |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日,%)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 22.10      | +0.80↑    | 标的历史40日波动率(日,%)          | 23.53     | -0.25↓                                                                                            |
|      | 平值看涨期权隐含波动率(日)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 19.50      | -0.35↓    | 平值看跌期权隐含波动率(日,%)         | 19.2      | +0.56↑                                                                                            |
| 行业消息 | 未来第一周(2022年7月10日-7月16日)天然橡胶东南亚主产区降雨增加明显。其中泰国东北部、南部大部分区域降雨量明显增加至高位红色预警状态,泰国其他区域降雨量也处于中偏高状态,柬埔寨、越南南部降雨量也增加至红色高位预警,整个东南亚区域降雨量增加明显,对割胶工作影响明显。<br>1、据隆众资讯统计,截至2022年07月10日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量37.77万吨,较上期增加0.84万吨,环比上涨2.27%,依旧处于僵持状态,同比缩减12.59万吨,跌幅25%。海外天胶产量提升,分流中国数量增加,预计本周青岛地区天胶现货库存存在增加可能。<br>2、QinRex最新数据显示,2022年前五个月美国进口轮胎共计12706万条,同比增13.1%。 |            |           |                          |           | <br>更多资讯请关注! |
| 观点总结 | 国内外主产区处于割胶期,泰国原料自6月份开始上量较快,但近期降雨偏多,原料价格维持平稳。国内云南版纳降雨较多,新鲜胶水产量偏低;海南目前割胶情况转好,胶水上量预期偏强,陆续进入全面开割状态,但目前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,依旧处于增减维持当中,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,上周轮胎厂开工率环比继续下降,个别企业因新订单有限,排产计划下调,加上成品库存维持高位,存停产或降负安排。盘面上,ru2209合约小幅收涨,短期建议在12500-12850区间交易。                                                 |            |           |                          |           | <br>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!

备注: ru: 天然橡胶 nr: 20号胶