



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

2022-10-31

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)	149.9	8.3↑	新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分)	120.8	-1.3↓
	沪胶主力合约收盘价 (日, 元/吨)	11750	-85↓	20号胶主力合约收盘价 (日, 元/吨)	8820	-95↓
	沪胶1-5价差(日,元/吨)	15	45↑	20号胶1-2价差(日,元/吨)	15	5↑
	沪胶与20号胶价差 (日, 元/吨)	2930	10↑	沪胶主力合约 持仓量 (日, 手)	192728	-4209↓
	20号胶主力合约持仓量 (日, 手)	61603	1399↑	沪胶前20名净持仓	-35863	2269↑
	20号胶前20名净持仓	-285	1019↑	沪胶交易所仓单 (日, 吨)	291330	-690↓
现货市场	20号胶交易所仓单 (日, 吨)	35259	202↑			
	上海市场国营全乳胶 (日, 元/吨)	11150	-150↓	上海市场越南3L (日, 元/吨)	11350	-150↓
	泰标STR20 (日, 美元/吨)	1275	-10↓	马标SMR20 (日, 美元/吨)	1260	-10↓
	泰国人民币混合胶 (日, 元/吨)	10300	-100↓	马来西亚人民币混合胶 (日, 元/吨)	10260	-100↓
	齐鲁石化丁苯1502 (日, 元/吨)	11200	0	齐鲁石化顺丁BR9000 (日, 元/吨)	11900	0
	沪胶主力合约标准品基差 (日, 元/吨)	-685	70↑	沪胶主力合约非标准品基差 (日, 元/吨)	-1535	120↑
上游情况	20号胶主力合约基差 (日, 元/吨)	190	245↑			
	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	48.15	-1.22↓	泰国合艾生胶片 (日, 泰铢/公斤)	46.39	-2.14↓
	泰国合艾胶水 (日, 泰铢/公斤)	47	-0.3↓	泰国合艾杯胶 (日, 泰铢/公斤)	37.7	-1.75↓
	云南产区原料(日,元/吨)	10300	-150↓	海南产区原料(日,元/吨)	10200	-300↓
	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	-33.69	9.49↑	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	5.21	-12↓
	技术分类天然橡胶月度进口量 (万吨)	10.97	-0.51↓	混合胶月度进口量 (万吨)	28.84	0.49↑
下游情况	标胶进口利润 (日, 美元/吨)	-5	10↑			
	全钢胎开工率 (周, %)	47.64	-4.5↓	半钢胎开工率 (周, %)	55.34	-9.43↓
期权市场	重卡销量 (辆, %)	52000	7000↑			
	标的历20日波动率 (日, %)	17.17	0.01↑	标的历40日波动率 (日, %)	8.29	0.03↑
行业消息	平值看涨期权隐含波动率 (日)	20.88	0.86↑	平值看跌期权隐含波动率 (日, %)	19.36	0.91↑
	未来第一周(2022年10月30日-11月05日)天然橡胶东南亚主产区整体降雨量较上一周期小幅减少,其中红色高位预警区域主要分布在越南东部以及菲律宾北部小部分地区,其他区域降雨量也处于偏低状态,对割胶工作影响减弱,赤道以南红色高位预警区域主要集中马来西亚西部部分地区以及印度尼西亚零星地区,其他区域降雨量处于中偏高状态,对割胶工作存在增强预期。					
	1、据国家统计局最新公布的数据显示,2022年9月中国橡胶轮胎外胎产量为7.5454万条,同比增加9.2%。1-9月橡胶轮胎外胎产量较上年同期降4.1%至6.39317亿条。 2、2022年前三季度,泰国出口天然橡胶(不含复合橡胶)合计为256.8万吨,同比增4.8%。其中,标胶合计出口130.7万吨,同比增11%;烟片胶出口34.4万吨,同比降6.8%;乳胶出口87万吨,同比增1%。					
观点总结	近期天然橡胶东南亚主产区整体降雨量逐步减少,对割胶工作影响减弱,海南产区天气回归正常,产量趋于增加。近期进口货源有所增加,青岛地区天胶库存有小幅增加的趋势,整体出库量有所下滑。需求方面,上周轮胎企业开工率环比下降,因广饶地区轮胎企业响应当地防控要求,存停限产安排,拖拽样本企业开工率走低。多地区公共卫生事件反复,居民出行减少,半钢胎替换需求平淡,轮胎企业成品库存居高不下,预计后期厂家更多的是选择控制排产及库存量。盘面上,ru2301合约继续下探,短线需谨防期价急跌后带来的反弹修正,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!