

| 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)  | 149.5 | -3.6↓  | 新加坡TSR20主力合约结算价(日,美分) | 130.2  | -2.1↓  |
|      | 沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)   | 12840 | 10↑    | 20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)    | 9700   | -30↓   |
|      | 沪胶1-5价差(日,元/吨)   | -70   | -25↓   | 20号胶11-12价差(日,元/吨)    | 25     | -35↓   |
|      | 沪胶与20号胶价差(日,元/吨)   | 3140  | 40↑    | 沪胶主力合约持仓量(日,手)        | 157563 | 905↑   |
|      | 20号胶主力合约持仓量(日,手)   | 50064 | 1666↑  | 沪胶前20名净持仓             | -31134 | -261↓  |
|      | 20号胶前20名净持仓  | -318  | 418↑   | 沪胶交易所仓单(日,吨)          | 286130 | 1340↑  |
|      | 20号胶交易所仓单(日,吨)   | 46831 | -806↓  |                       |        |        |
| 现货市场 | 上海市场国营全乳胶(日,元/吨)   | 11900 | 0      | 上海市场越南3L(日,元/吨)       | 11850  | 0      |
|      | 泰标STR20(日,美元/吨)  | 1380  | -5↓    | 马标SMR20(日,美元/吨)       | 1370   | -5↓    |
|      | 泰国人民币混合胶(日,元/吨)  | 11150 | -50↓   | 马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)     | 11110  | -50↓   |
|      | 齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)  | 11500 | -200↓  | 齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)   | 12200  | 0      |
|      | 沪胶主力合约标准品基差(日,元/吨)   | -930  | -15↓   | 沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)   | -1680  | -65↓   |
|      | 20号胶主力合约基差(日,元/吨)  | 80    | -33↓   |                       |        |        |
| 上游情况 | 泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)  | 51.4  | 0.52↑  | 泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)      | 48.68  | 0.29↑  |
|      | 泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)  | 46.8  | 0.1↑   | 泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)       | 42.2   | -0.15↓ |
|      | 云南产区原料(日,元/吨)  | 11100 | -50↓   | 海南产区原料(日,元/吨)         | 10200  | -200↓  |
|      | 泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)   | 42.32 | 4.97↑  | 泰国标胶加工利润(日,美元/吨)      | 40.99  | 4.44↑  |
|      | 技术分类天然橡胶月度进口量(万吨)  | 11.48 | 1.9↑   | 混合胶月度进口量(万吨)          | 28.35  | 0.08↑  |
|      | 标胶进口利润(日,美元/吨)   | -15   | -5↓    |                       |        |        |
| 下游情况 | 全钢胎开工率(周,%)  | 58.91 | 24.82↑ | 半钢胎开工率(周,%)           | 64.4   | 23.76↑ |
|      | 重卡销量(辆,%)  | 52000 | 7000↑  |                       |        |        |
| 期权市场 | 标的历史20日波动率(日,%)  | 18.99 | 0      | 标的历史40日波动率(日,%)       | 7.79   | 0.05↑  |
|      | 平值看涨期权隐含波动率(日)   | 19.41 | -0.69↓ | 平值看跌期权隐含波动率(日,%)      | 18.83  | -0.35↓ |
| 行业消息 | <p>未来第一周(2022年10月16日-10月22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缩小,主要分布在泰国南部、越南东部以及菲律宾北部地区,其他区域降雨量也处于中等偏高状态,对割胶工作影响增强,赤道以南红色高位预警区域主要集中马来西亚西部零星地区,其他区域降雨量小幅度增多,对割胶工作存在增强预期。</p> <p>1、据隆众资讯统计,截至2022年10月9日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量37.24万吨,较上期增加0.28万吨,环比增幅0.76%。预计下期青岛地区保税和一般贸易库存整体变化不会太大,主要关注假期后终端采购情况和市场到货量情况。</p> <p>2、根据第一商用车网初步掌握的数据,今年9月份,我国重卡市场大约销售5.2万辆左右(开票口径),环比今年8月上涨13%,比上年同期的5.92万辆下降12%,净减少约7200辆。</p> |       |        |                       |        |        |
|      | <p>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。国内云南产区天气较好,但海南产区受台风影响降雨增加,对割胶工作有所影响。近期虽然进口货源有所增加,但是仓库一直未有放量迹象。需求方面,前期检修企业开工逐步提升,上周轮胎企业开工率环比大幅回升,但轮胎企业成品库存继续增加,预计后期厂家更多的是选择控制排产及库存量。当前海外需求无明显起色,多地公共卫生事件持续扰动,物流运输等受限,需要持续关注。盘面上,ru2301合约小幅收涨,短期建议在12720-12950区间交易。</p>   |       |        |                       |        |        |
| 观点总结 |  |       |        |                       |        |        |
| 提示关注 | 周四隆众轮胎样本企业开工率  |       |        |                       |        |        |