

分析师:张昕 从业资格证号:F03109641 投资咨询从业证号:Z0018457

| 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) | 154.4 | 2.9 | 沪胶主力合约收盘价(日,元/吨) | 11975 | -235 |
| | 20号胶主力合约收盘价(日,元/吨) | 9405 | -115 | 沪胶9-1价差(日,元/吨) | -950 | 15 |
| | 20号胶10-11价差(日,元/吨) | -40 | -5 | 沪胶与20号胶价差(日,元/吨) | 2570 | -120 |
| | 沪胶主力合约持仓量(日,手) | 130844 | -9625 | 20号胶主力合约持仓量(日,手) | 72982 | 893 |
| | 沪胶前20名净持仓 | -60432 | 3215 | 20号胶前20名净持仓 | -6817 | 994 |
| | 沪胶交易所仓单(日,吨) | 175740 | 960 | 20号胶交易所仓单(日,吨) | 70862 | -202 |
| | 现货市场 | 上海市场国营全乳胶(日,元/吨) | 12050 | -150 | 上海市场越南3L(日,元/吨) | 11250 |
| 泰标STR20(日,美元/吨) | | 1340 | 0 | 马标SMR20(日,美元/吨) | 1340 | 0 |
| 泰国人民币混合胶(日,元/吨) | | 10570 | 20 | 马来西亚人民币混合胶(日,元/吨) | 10520 | 0 |
| 齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨) | | 11800 | 0 | 齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨) | 10900 | 0 |
| 沪胶基差(日,元/吨) | | 75 | 85 | 沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨) | -1640 | -5 |
| 青岛市场20号胶(日,元/吨) | | 9513 | 11 | 20号胶主力合约基差(日,元/吨) | 108 | 126 |
| 上游情况 | | 泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤) | 45.5 | -0.76 | 泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤) | 44.2 |
| | 泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤) | 41 | -0.6 | 泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤) | 37.7 | -0.55 |
| | 泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨) | -32.6 | 7.24 | 泰国标胶加工利润(日,美元/吨) | -21.39 | 3.76 |
| | 技术分类天然橡胶月度进口量(万吨) | 13.84 | -1.8 | 混合胶月度进口量(万吨) | 31.39 | 3.59 |
| 下游情况 | 全钢胎开工率(周,%) | 62.41 | -0.08 | 半钢胎开工率(周,%) | 71.74 | 0.14 |
| | 标的历史20日波动率(日,%) | 15.1 | -1.43 | 标的历史40日波动率(日,%) | 7.16 | -0.07 |
| 期权市场 | 平值看涨期权隐含波动率(日) | 24.28 | -0.99 | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 24.37 | 0.08 |
| | 行业消息 | <p>未来第一周(2023年7月30日-8月5日)天然橡胶东南亚主产区降雨量较上一周期增加,其中红色高位预警区域主要集中在缅甸南部及柬埔寨等地区,其他区域降水处于中偏低状态,对割胶工作影响持小幅增强预期,赤道以南红色高位预警区主要分布在印尼西部地区,其他区域降雨量处于偏低状态,对割胶工作影响存小幅增强预期。1、根据第一商用车网初步掌握的数据,2023年7月份,我国重卡市场大约销售6.5万辆左右(开票口径,包含出口和新能源),环比2023年6月下月下滑25%,比上年同期的4.5万辆增长44%,净增加约2万辆。2、据隆众资讯统计,截至2023年7月30日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量92万吨,较上期减少0.59万吨,环比缩减0.64%。保税区库存环比减少1.07%至13.88万吨,一般贸易库存环比减少0.56%至78.13万吨,青岛天然橡胶样本保税仓库入库率减少0.54个百分点;出库率减少0.34个百分点;一般贸易仓库入库率减少0.04个百分点,出库率减少0.24个百分点。</p> | | | | |
| 观点总结 | <p>目前国内产区处于季节性割胶期,云南和海南产区胶水利全乳和制浓乳胶价差均维持平水。近期下游轮胎工厂刚需逢低补货,加上台风天气对货物到港形成扰动,青岛地区一般贸易及保税库存继续下降,带动青岛总库存量下降,但整体库存仍处于高水平状态,对现货价格形成压制。需求方面,上周国内轮胎企业产能利用率基本表现平稳,个别企业小幅降负,产能释放受限。半钢胎企业排产延续稳定,内外贸均出货顺畅,库存储备合理范围内小幅波动;全钢胎个别企业外因拖拽,产出受限,企业库存储备环比略有减少,预计短期轮胎企业产能利用率窄幅波动为主。ru2309合约期价跌破前期支撑,短线关注11880附近支撑力度,建议暂以观望为主。</p> | | | | | |
| 提示关注 | 周四隆众轮胎样本企业开工率 | | | | | |



更多资讯请关注!



更多观点请咨询!

数据来源于第三方,仅供参考。市场有风险,投资需谨慎!

免责声明

本报告中的信息均来源于公开可获得资料,瑞达期货股份有限公司力求准确可靠,但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证,据此投资,责任自负。本报告不构成个人投资建议,客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告版权仅为我公司所有,未经书面许可,任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布。如引用、刊发,需注明出处为

瑞达期货股份有限公司研究院，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。

瑞达研究