

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	沪胶主力合约收盘价(日,元/吨)	16180	105	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	12660	125
	沪胶9-1价差(日,元/吨)	-1330	-15	20号胶10-11价差(日,元/吨)	-110	10
	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	3520	-20	沪胶主力合约持仓量(日,手)	166814	4125
	20号胶主力合约持仓量(日,手)	54457	2027	沪胶前20名净持仓	-30273	33
	20号胶前20名净持仓	-4327	1330	沪胶交易所仓单(日,吨)	239410	1910
	20号胶交易所仓单(日,吨)	139810	-2721			
现货市场	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	14800	100	上海市场越南3L(日,元/吨)	14950	-200
	泰标STR20(日,美元/吨)	1800	-20	马标SMR20(日,美元/吨)	1795	-20
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	14520	-160	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	14400	-160
	齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)	15600	0	齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)	15400	0
	沪胶基差(日,元/吨)	-1380	-5	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	-1555	50
	青岛市场20号胶(日,元/吨)	12771	-136	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	111	-261
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	83.59	1.06	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	79.69	0.47
	泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)	68.2	-0.4	泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)	56.35	-0.45
	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	140.57	-0.46	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	-101.36	-5.93
	技术分类天然橡胶月度进口量(万吨)	12.7	1.37	混合胶月度进口量(万吨)	25.35	6.82
	标胶进口利润(日,美元/吨)	-30	0			
下游情况	全钢胎开工率(周,%)	58.85	0.54	半钢胎开工率(周,%)	78.96	-0.03
	重卡销量(辆,%)	58000	-1000			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	13.66	-0.03	标的历史40日波动率(日,%)	13.59	0.07
	平值看涨期权隐含波动率(日)	19.64	0.08	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	19.63	0.06
行业消息	未来第一周(2024年9月1日-9月7日)天然橡胶东南亚主产区降雨量较上一周期增加,赤道以北红色区域主要集中在泰国南部、越南中部、柬埔寨西南部等地区,其余大部分区域降水处于中等状态,对割胶工作影响增加,赤道以南红色区域主暂无,其他大部分区域降雨量处于偏低状态,对割胶工作影响减弱预期。1、据隆众资讯统计,截至2024年9月1日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量45.52万吨,环比上期减少0.5万吨,降幅1.08%。保税区库存6.10万吨,增幅2.06%;一般贸易库存39.41万吨,降幅1.55%。青岛天然橡胶样本保税仓库入库率增加1.36个百分点;出库率减少2.20个百分点;一般贸易仓库入库率减少0.72个百分点,出库率减少0.87个百分点。2、根据第一商用车网初步掌握的数据,2024年8月份,我国重卡市场销售约5.8万辆左右(批发口径,包含出口和新能源),环比7月份基本持平,比上年同期的7.12万辆下滑18%,减少了约1.3万辆。累计来看,2024年1-8月,我国重卡市场销售各类车型约62.1万辆,累计增速进一步缩窄至同比持平的状态。					
观点总结	近期全球产区处于季节性上量阶段,当前国内云南产区降雨扰动减少,步入收胶阶段,但原料产出上量情况始终不及预期,胶水价格较为强势。上周青岛仓库现货库存呈现去库,保税小幅累库,一般贸易库维持去库;据悉本周海关通关开始恢复正常,伴随海外部分8月装船货陆续到港,青岛港口保税仓库入库量将呈现明显增加。本周国内半钢胎企业排产稳定,整体产能利用率延续高位运行;全钢胎企业因前期检修复工复产,对整体产能利用率形成一定拉动。ru2501合约短线建议在15900-16300区间交易, nr2410合约短线建议在12430-12700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!

研究员: 黄青青 期货从业资格号F3004212 期货投资咨询从业证书号Z0012250

助理研究员: 徐天泽 期货从业资格号F03133092

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