

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)	15010	55	20号胶主力合约收盘价(日,元/吨)	12420	15
	沪胶9-1价差(日,元/吨)	-1125	20	20号胶8-9价差(日,元/吨)	-80	10
	沪胶与20号胶价差(日,元/吨)	2590	40	沪胶主力合约持仓量(日,手)	220986	8517
	20号胶主力合约持仓量(日,手)	36300	-3618	沪胶前20名净持仓	-48075	-815
	20号胶前20名净持仓	-5633	-97	沪胶交易所仓单(日,吨)	220220	1470
	20号胶交易所仓单(日,吨)	137390	-1814			
现货市场	上海市场国营全乳胶(日,元/吨)	14550	-100	上海市场越南3L(日,元/吨)	14850	0
	泰标STR20(日,美元/吨)	1715	-5	马标SMR20(日,美元/吨)	1710	0
	泰国人民币混合胶(日,元/吨)	14600	0	马来西亚人民币混合胶(日,元/吨)	14450	0
	齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨)	15500	0	齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨)	15400	0
	沪胶基差(日,元/吨)	-460	-155	沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨)	-355	-30
	青岛市场20号胶(日,元/吨)	12222	-36	20号胶主力合约基差(日,元/吨)	-198	-51
上游情况	泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤)	73.23	-1.65	泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤)	72.38	-0.3
	泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤)	70.45	0	泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤)	57.85	-0.65
	泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨)	91.41	23.25	泰国标胶加工利润(日,美元/吨)	-53.43	-5.85
	技术分类天然橡胶月度进口量(万吨)	13.97	-1.48	混合胶月度进口量(万吨)	19.46	-8.63
	标胶进口利润(日,美元/吨)	-60	0			
下游情况	全钢胎开工率(周,%)	62.46	4.29	半钢胎开工率(周,%)	79.31	0.25
	重卡销量(辆,%)	75000	-12000			
期权市场	标的历史20日波动率(日,%)	27.88	-0.77	标的历史40日波动率(日,%)	23.31	-0.24
	平值看涨期权隐含波动率(日)	23.75	-0.35	平值看跌期权隐含波动率(日,%)	23.75	-0.34
行业消息	未来第一周(2024年6月30日-7月6日)天然橡胶东南亚主产区降雨量较上一周期减少,赤道以北红色区域主要集中在柬埔寨南部地区,其余大部分区域降水处于偏低状态,对割胶工作影响减弱,赤道以南红色区域主要分布在印尼东南部零星地区,其他大部分区域降雨量处于中等偏低状态,对割胶工作影响存小幅增强预期。1、据隆众资讯统计,截至2024年6月30日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量49.75万吨,环比上期减少1.37万吨,降幅2.68%。保税区库存6.67万吨,降幅4.59%;一般贸易库存43.08万吨,降幅2.38%。青岛天然橡胶样本保税仓库入库率增加0.73个百分点;出库率减少1.94个百分点;一般贸易仓库入库率减少0.55个百分点,出库率减少0.42个百分点。2、最新数据显示,2024年前5个月,泰国出口天然橡胶(不含复合橡胶)合计为122.7万吨,同比增10%。其中,标胶合计出口78.4万吨,同比增31%;烟片胶出口13.9万吨,同比降9%;乳胶出口29.4万吨,同比降16%。					
观点总结	近期全球产区处于季节性上量阶段,天气仍对割胶形成扰动,供应依然偏紧;国内云南产区云南替代指标陆续进入,工厂原料紧张得到缓解,对原料收购价格形成压制。近期海外标胶有集中到港预期,但下游工厂逢低采购,青岛地区库存延续去库,总去库幅度环比缩窄。上周国内半钢胎企业内销整体出货一般,出口受海运费波动影响,产能利用率小幅波动;全钢胎企业个别检修排产逐步恢复至常规水平,带动产能利用率继续提升。ru2409合约短线关注14850附近支撑,nr2408合约短线关注12200附近支撑,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!

研究员: 蔡跃辉 期货从业资格号F0251444 期货投资咨询从业证书号Z0013101
助理研究员: 郑嘉岚 期货从业资格号F03110073

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。