

撰写人:林静宜 从业资格证号:F0309984 投资咨询从业证号:Z0013465

| 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) | 152.4 | -0.6 | 沪胶主力合约收盘价(日,元/吨) | 12010 | -60 |
| | 20号胶主力合约收盘价(日,元/吨) | 9750 | -25 | 沪胶9-1价差(日,元/吨) | -1105 | -15 |
| | 20号胶7-8价差(日,元/吨) | -45 | -5 | 沪胶与20号胶价差(日,元/吨) | 2305 | 10 |
| | 沪胶主力合约持仓量(日,手) | 294143 | -6726 | 20号胶主力合约持仓量(日,手) | 69172 | -820 |
| | 沪胶前20名净持仓 | -74768 | 2469 | 20号胶前20名净持仓 | -3452 | 184 |
| | 沪胶交易所仓单(日,吨) | 183860 | -80 | 20号胶交易所仓单(日,吨) | 51308 | 1613 |
| | 现货市场 | 上海市场国营全乳胶(日,元/吨) | 11850 | 250 | 上海市场越南3L(日,元/吨) | 11350 |
| 泰标STR20(日,美元/吨) | | 1400 | 25 | 马标SMR20(日,美元/吨) | 1395 | 25 |
| 泰国人民币混合胶(日,元/吨) | | 10850 | 200 | 马来西亚人民币混合胶(日,元/吨) | 10800 | 170 |
| 齐鲁石化丁苯1502(日,元/吨) | | 12000 | 0 | 齐鲁石化顺丁BR9000(日,元/吨) | 11200 | 0 |
| 沪胶基差(日,元/吨) | | -160 | 310 | 沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨) | -1220 | -140 |
| 青岛市场20号胶(日,元/吨) | | 9682 | 248 | 20号胶主力合约基差(日,元/吨) | -23 | 318 |
| 上游情况 | 泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤) | 50.29 | 0.07 | 泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤) | 47.47 | 0 |
| | 泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤) | 42.5 | 0 | 泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤) | 39.8 | 0.15 |
| | 泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨) | -49.41 | 7.83 | 泰国标胶加工利润(日,美元/吨) | -3.23 | 17.9 |
| | 技术分类天然橡胶月度进口量(万吨) | 16.17 | 1.84 | 混合胶月度进口量(万吨) | 34.79 | -0.74 |
| 下游情况 | 全钢胎开工率(周,%) | 44.21 | -19.69 | 半钢胎开工率(周,%) | 60.38 | -10.28 |
| | 标的历史20日波动率(日,%) | 20.09 | -0.41 | 标的历史40日波动率(日,%) | 14.27 | -0.41 |
| 期权市场 | 平值看涨期权隐含波动率(日) | 23.41 | 0.22 | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 23.43 | 0.24 |
| | 行业消息 | <p>未来第一周(2023年5月7日-5月13日)天然橡胶东南亚主产区降雨量较上一周期大幅增量,其中红色高位预警区域主要集中于缅甸南部,其他区域降水处于中等或偏低状态,对割胶工作影响持增加预期,赤道以南红色高位预警区主要分布在新西兰地区,其他区域降雨量处于中偏低状态,对割胶工作影响存小幅增加预期。</p> <p>1、根据第一商用车网初步掌握的数据,2023年4月份,我国重卡市场大约销售8万辆左右(开票口径,包含出口和新能源),环比2023年3月下滑31%,比上年同期的4.4万辆增长83%,净增加约3.6万辆。这是今年市场继2月份以来的第三个月同比增长,今年1-4月,重卡市场累计销售32.1万辆,同比上涨17%。</p> <p>2、据隆众资讯统计,截至2023年5月8日,青岛地区天胶保税和一般贸易合计库存量73.4万吨,较上期增加1.4万吨,环比增幅1.97%。保税区库存环比增加4.38%至11.4万吨,一般贸易库存环比增加1.53%至61.99万吨,青岛天然橡胶样本保税仓库入库率增加1.35个百分点;出库率下降3.7个百分点;一般贸易仓库入库率下降4.95个百分点,出库率下降2.96个百分点。</p> | | | | |
| 观点总结 | <p>目前国内产区进入季节性开割期,国内云南产区受气候影响,全面开割预计推迟,近期收购胶水鲜少。港口货源持续到港,而终端采购多数随用随采,青岛地区天然橡胶保税库存和一般贸易库存量继续增加,整体仍入库大于出库,预计短期累库的趋势难以改善。需求方面,上周国内轮胎企业产能利用率环比大幅下降,因假期山东东营、潍坊地区部分全钢胎企业受热电厂检修等因素影响生产受限,另有部分企业为控制库存增速而短期停工检修,而随着检修企业逐步复工,本周轮胎样本企业产能利用率预计明显提升,但成品库存增加或限制开工率的提升空间。ru2309合约短期或延续区间震荡,关注12250附近压力,建议在11900-12250区间交易。</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