

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) | 150.3 | -2.7 | 沪胶主力合约收盘价(日,元/吨) | 12185 | -115 |
| | 20号胶主力合约收盘价(日,元/吨) | 9505 | -45 | 沪胶9-1价差(日,元/吨) | -980 | -5 |
| | 20号胶9-10价差(日,元/吨) | -15 | 0 | 沪胶与20号胶价差(日,元/吨) | 2680 | -70 |
| | 沪胶主力合约持仓量(日,手) | 141166 | -10686 | 20号胶主力合约持仓量(日,手) | 72679 | 1508 |
| | 沪胶前20名净持仓 | -65406 | -3065 | 20号胶前20名净持仓 | -7904 | 488 |
| | 沪胶交易所仓单(日,吨) | 174800 | -70 | 20号胶交易所仓单(日,吨) | 71064 | -404 |
| | 现货市场 | 上海市场国营全乳胶(日,元/吨) | 12300 | 275 | 上海市场越南3L(日,元/吨) | 11300 |
| 泰标STR20(日,美元/吨) | | 1350 | 10 | 马标SMR20(日,美元/吨) | 1350 | 10 |
| 泰国人民币混合胶(日,元/吨) | | 10600 | 80 | 马来西亚人民币混合胶(日,元/吨) | 10550 | 80 |
| 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) | | 115 | 390 | 沪胶主力合约非标准品基差(日,元/吨) | -1700 | -15 |
| 青岛市场20号胶(日,元/吨) | | 9626 | 138 | 20号胶主力合约基差(日,元/吨) | 121 | 183 |
| 上游情况 | 泰国合艾烟片(日,泰铢/公斤) | 46.26 | 0 | 泰国合艾生胶片(日,泰铢/公斤) | 44.55 | 0 |
| | 泰国合艾胶水(日,泰铢/公斤) | 41.6 | 0 | 泰国合艾杯胶(日,泰铢/公斤) | 38.25 | 0 |
| | 泰国3号烟片加工利润(日,美元/吨) | -39.84 | 3.7 | 泰国标胶加工利润(日,美元/吨) | -25.15 | 4.44 |
| | 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,%) | 16.83 | 0.36 | 标的历史40日波动率(日,%) | 7.76 | 0.02 |
| 期权市场 | 平值看涨期权隐含波动率(日) | 25.27 | -0.27 | 平值看跌期权隐含波动率(日,%) | 25.27 | -0.27 |
| | 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、2023年上半年,泰国出口天然橡胶(不含复合橡胶)合计为130.7万吨,同比降23%。其中,标胶合计出口71.6万吨,同比降15%;烟片胶出口17.8万吨,同比降25%;乳胶出口40.2万吨,同比降32%。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合约短线关注12100附近支撑,建议维持震荡思路对待。</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