

撰写人: 许方莉 从业资格号: F3073708 投资咨询从业证书号: Z0017638

项目类别	数据指标	最新	环比	数据指标	最新	环比
期货市场	菜粕01合约收盘价(日, 元/吨)	2,767.00	-2.00↓	菜油09合约收盘价(日, 元/吨)	11,083.00	-490.00↓
	菜粕9-1价差(日, 元/吨)	564.00	-5.00↓	菜油9-1价差(日, 元/吨)	478.00	-11.00↓
	菜粕持仓量(日, 手)	217,205.00	+8786.00↑	菜油持仓量(日, 手)	120,662.00	+4458.00↑
	菜粕期货前20名净持仓(日, 手)	16,995.00	+2574.00↑	菜油期货前20名净持仓(日, 手)	-10,188.00	+651.00↑
	菜粕仓单(日, 张)	1,828.00	-183.00↓	菜油仓单(日, 张)	0.00	0.00
	ICE油菜籽7月合约收盘价(加元/吨)	846.80	-31.70↓	菜籽主力合约收盘价(日, 元/吨)	6,490.00	-82.00↓
现货市场	江苏南通菜粕价格(日, 元/吨)	3,470.00	0.00	江苏菜油价格(日, 元/吨)	12,030.00	-210.00↓
	油菜籽进口价格(广东, 日, 元/吨)	6,577.32	-187.83↓	菜油成本价(加拿大, 日, 元/吨)	14,090.84	-8.15↓
	国产油菜籽价格(江苏, 日, 元/吨)	6,900.00	0.00	油粕比(江苏菜油/菜粕, 日)	3.47	-0.06↓
	菜粕主力合约基差(日, 元/吨)	703.00	+2.00↑	菜油主力合约基差(日, 元/吨)	947.00	+280.00↑
替代品现货价格	江苏南京豆油价格(日, 元/吨)	10,050.00	-250.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	1,980.00	+40.00↑
	广东广州棕榈油价格(日, 元/吨)	10,020.00	-100.00↓	与菜油价差(日, 元/吨)	2,010.00	-110.00↓
	江苏张家港豆粕价格(日, 元/吨)	4,020.00	+20.00↑	与菜粕价差(日, 元/吨)	550.00	+20.00↑
上游情况	加拿大油菜籽产量预估(月, 万吨)	2,000.00	0.00	我国油菜籽产量预估(月, 万吨)	1,470.00	0.00
	油菜籽进口量(月, 万吨)	13.03	+5.14↑	油菜籽进口压榨利润(日, 元/吨)	-298.00	-132.00↓
	沿海油厂油菜籽库存(周, 万吨)	15.20	-3.40↓	进口油菜籽开机率(周, %)	4.07	-11.31↓
产业情况	颗粒菜粕进口量(月, 万吨)	24.23	+5.24↑	菜籽油进口量(月, 万吨)	12.00	+5.00↑
	华南地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	11.00	-0.40↓	菜籽油华东库存(周, 万吨)	19.00	+0.86↑
	沿海地区菜粕库存(周, 万吨)	5.44	-0.65↓	菜籽油沿海库存(周, 万吨)	0.9	-0.26↓
	华东地区颗粒菜粕库存(周, 万吨)	25.50	-2.08↓	菜籽油广西库存(周, 万吨)	0.55	-0.25↓
	菜粕提货量(周, 万吨)	1.03	+1.07↑	菜油提货量(周, 万吨)	0.02	-0.49↓
下游情况	水产饲料产量(月, 吨)	252.00	+62.00↑	餐饮收入(月, 亿元)	3,012.30	+403.40↑
	饲料总产量(月, 吨)	2,352.00	+103.00↑	食用植物油产量(月, 万吨)	406.10	+46.70↑
期权市场	菜粕平值看涨期权波动率(%)	29.54		菜粕平值看跌期权波动率(%)	32.85	
	标的20日历史波动率(%)	64.6	+0.14↑	标的60日历史波动率(%)	44.72	-0.09↓
行业消息	<p>1、 周一洲际交易所(ICE)加拿大油菜籽期货市场收盘大幅下跌, 其中基准期约收低3.6%, 因为外部市场走低。截至收盘, 11月期约收低31.70加元, 报收846.80加元/吨;1月期约收低32.70加元, 报收853.80加元/吨;3月期约收低33.80加元, 报收860.60加元/吨。</p> <p>2、</p>				<p>更多资讯请关注!</p>	
观点总结 菜粕	<p>加拿大统计局将于7月5日20:30公布加拿大作物种植面积预估, 分析师预估, 加拿大2022年油菜籽种植面积料为2130万英亩, 高于加拿大统计局4月预估值2090万英亩, 同时, 预报显示7月初加拿大大草原天气条件有利, 加籽再度承压。且金融市场仍承受美国加息及全球经济衰退预期的压力。国内方面, 进口菜籽压榨再度减少, 菜粕库存小幅回落, 不过下游采购仍不积极, 库存水平仍然处于同期高位, 且国内大豆短期供应充足, 油厂开机率尚可, 豆粕库存持续增加, 蛋白粕整体库存压力加大。盘面来看, 菜粕期价持续偏弱, 短期仍有走弱倾向。</p>				<p>更多观点请咨询!</p>	
观点总结 菜油	<p>加拿大统计局将于7月5日20:30公布加拿大作物种植面积预估, 分析师预估, 加拿大2022年油菜籽种植面积料为2130万英亩, 高于加拿大统计局4月预估值2090万英亩, 同时, 预报显示7月初加拿大大草原天气条件有利, 加籽再度承压。同时, 印尼为加速棕榈油出口, 宣布自7月1日起, 将企业的最高出口配额从国内销售量的五倍提高到七倍, 库存压力正在重塑远期全球油脂市场的供需格局, 继续施压油脂市场。另外, 金融市场仍承受美国加息及全球经济衰退预期的压力。国内市场方面, 疫情影响下, 菜油需求明显弱于往年同期, 且国内菜籽上市导致菜油价格受到一定压制。但是今年国内新籽收购价格高昂, 且油厂开机率持续处于最低水平, 菜油产出有限, 而下游提货情况尚可, 沿海地区菜油库存继续下降, 库存压力较小。盘面来看, 在外盘持续偏弱影响下, 菜油再度下跌, 市场氛围仍然较弱, 暂且观望。</p>					
重点关注	周一我的农产品网油菜籽开机率及各地区菜油粕库存量, 7月5日加拿大统计局种植面积预估					